

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年12月20日-12月24日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（12月24日）报6.3692，较前周贬值约0.06%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.07%，上周最高6.3653、最低6.3885，收于6.3700，波幅为0.36%。上周受美元指数下行等因素影响，人民币对美元汇率小幅升值。预计人民币汇率窄幅震荡，受国常会提出要保持人民币汇率基本稳定、年末市场交投清淡等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3500-6.4000区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点小幅震荡，截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行8个点，上周最高1638.88、最低1554，收于1588，波幅为5.32%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行183个点，上周最高6.5703、最低6.5160，收于6.5335，波幅为0.83%。

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末 (点)	较去年 末 (点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.3692	41	-102	-1557
银行间市场汇价	6.3653	6.3885	6.3700	-42	52	-1698
掉期点						
1 个月期限	188	168	169.5	-4	-26.5	39.5
2 个月期限	363.5	333.5	340	1	-28	68
3 个月期限	488	453	460	10	-2	75
6 个月期限	886.88	848.01	848.01	-6.99	-22.49	108.01
1 年期限	1638.88	1554	1588	-8	-58	157

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期 (NDF) 汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差 (点)
1 个月期限	6.4205	6.3700	6.3875	-163	-1387	5.5
2 个月期限	6.4380	6.3855	6.403	-163	-1352	-10
3 个月期限	6.4512	6.3990	6.4165	-161	-1347	5
6 个月期限	6.4825	6.4410	6.4585	-153	-1285	36.99
1 年期限	6.5703	6.5160	6.5335	-183	-1257	47

数据来源：路透

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。