

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年12月10日-12月14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14日）报6.8750，较前周贬值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.26%，上周最高6.8629、最低6.9161，收于6.8975，波幅为0.77%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势。预计本周人民币汇率可能维持宽幅震荡格局，交投区间主要集中在6.8500-6.9500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃程度一般，呈区间震荡走势。上周一（12月10日），由市场资金面宽松，各期限掉期点有所下行；上周二（12月11日），市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅反弹；上周三（12月12日），市场买卖盘力量均衡，各期限掉期点与前一交易日基本持平；上周四（12月13日），市场交投较为活跃，市场资金面均衡偏紧，各期限掉期点震荡上行；上周五，市场交投一般活跃，市场资金面均衡偏紧，市场延续上行走势。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上涨57个点，上周最高-240、最低-324，收于-258，波幅为32.56%。

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。

- 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）较前周上涨104个点，上周最高6.9717、最低6.8965，收于6.9452，波幅为1.08%。

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	-	-	6.8750	86	-607	3408
银行间市场汇价	6.9161	6.8629	6.8975	177	-461	3855
掉期点						
1个月期限	3	-3	0.03	0.02	-0.97	-115.97
2个月期限	-3.80	-14	-4	6	-0.50	-244
3个月期限	-20	-37.30	-20	8	-5.50	-347
6个月期限	-85	-119.30	-94	16	-24	-669
1年期限	-240	-324	-258	57	-25	-1256

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	6.9250	6.8600	6.9052	154	3841	76.97
2个月期限	6.9335	6.8665	6.9127	144	3769	156
3个月期限	6.9390	6.8725	6.9187	154	3705	232
6个月期限	6.9530	6.8825	6.9312	134	3483	431
1年期限	6.9717	6.8965	6.9452	104	2957	735

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。