

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年12月2日-12月6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6日）报7.0383，较前周贬值约0.12%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.11%，上周最高7.0260、最低7.0750，收于7.0340，波幅为0.70%。上周境内人民币汇率维持窄幅震荡走势。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在7.0000-7.0600。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点冲高回落。上周一（12月2日），受美元买盘推动，各期限掉期点震荡上行；上周二（12月3日），资金面相对宽松，各期限掉期点小幅下行；上周随后两个交易日，1个月期跨年度及2个月期跨春节资金供不应求，短端掉期点高位震荡；上周五，央行超额续作中期借贷便利（MLF），资金面均衡偏松，各期限掉期点震荡下行。截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行2个点，上周最高475、最低373，收于443，波幅为23.02%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行 93 个点，上周最高 7.1570、最低 7.0821，收于 7.0969，波幅为 1.06%。

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	-	-	7.0383	85	85	1751
银行间市场汇价	7.0750	7.0260	7.0340	79	79	1682
掉期点						
1 个月期限	92	77	81	7	7	81.55
2 个月期限	184.50	140	141	-1	-1	163
3 个月期限	196	0	180	-6	-6	217
6 个月期限	300	0	280	5	5	394
1 年期限	475	373	443	-2	-2	720

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	7.0845	7.0189	7.0239	-72	1418	-182
2 个月期限	7.0922	7.0249	7.0314	-67	1443	-167
3 个月期限	7.0985	7.0301	7.0381	-65	1460	-139
6 个月期限	7.1222	7.0450	7.0579	-47	1603	-41
1 年期限	7.1570	7.0821	7.0969	93	1923	186

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。