

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年11月11日-11月15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（11月15日）报7.0091，较前周贬值约0.21%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.34%，上周最高6.9922、最低7.0272，收于7.0121，波幅为0.50%。上周境内人民币汇率维持区间震荡走势。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6.9500-7.0500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈震荡上行走势。上周一（11月11日），受周末CPI数据高于预期影响，市场高开高走，各期限掉期点全天震荡上行；上周二（11月12日），受资金面偏紧影响，各期限掉期点小幅上行；上周三（11月13日），受资金面紧张局面趋缓的影响，各期限掉期点冲高回落；上周四（11月14日），市场交投较为清淡，各期限掉期点有所下行；上周五，市场交投比较活跃，市场买盘踊跃，各期限掉期点全天震荡上行。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上行36个点，上周最高461、最低420，收于445，波幅为9.21%。

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）较前周上行362个点，上周最高7.1110，最低7.0500，收于7.0771，波幅为0.86%。

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	—	—	7.0091	146	-442	1459
银行间市场汇价	6.9922	7.0272	7.0121	237	-329	1342
掉期点						
1个月期限	73.0	0.0	66.0	8.8	16.0	75.8
2个月期限	140	0	130	20	31	152
3个月期限	275	56	179	19	39	216
6个月期限	441	262	282	27	54	397
1年期限	461	420	445	49	78	724

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	7.0393	6.9860	7.0076	171	1381	-111
2个月期限	7.0460	6.9915	7.0141	186	1401	-110
3个月期限	7.0550	6.9973	7.0206	191	1411	-94
6个月期限	7.0730	7.0100	7.0406	216	1546	3
1年期限	7.1110	7.0500	7.0771	362	1851	205

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。