

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年11月25日-11月29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29日）报7.0298，较前周升值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.14%，上周最高7.0181、最低7.0420，收于7.0261，波幅为0.34%。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7.0000-7.0500。
- 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25日），美元买盘相对活跃，各期限掉期点震荡上行；上周二（11月26日），受央行公开市场操作净回收流动性影响，资金面边际收紧，各期限掉期点延续上行行情；上周三（11月27日），市场资金面相对均衡，各期限掉期点窄幅震荡；上周四（11月28日），市场买卖力量相对均衡，各期限掉期点区间震荡；上周五，市场资金面整体均衡，各期限掉期点延续震荡行情。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30个点，上周最高455、最低410，收于445，波幅为10.11%。

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）较前周下行265个点，上周最高7.1165、最低7.0748，收于7.0876，波幅为0.59%。

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	-	-	7.0298	-8	-235	1666
银行间市场汇价	7.0420	7.0181	7.0261	-95	-89	1603
掉期点						
1个月期限	75	0	74	30	24	74.55
2个月期限	523	70	142	26	43	164
3个月期限	186	0	186	36	46	223
6个月期限	286	97	275	29	47	389
1年期限	455	410	445	30	80	722

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	7.0435	7.0096	7.0311	-66	1490	-24
2个月期限	7.0515	7.0150	7.0381	-110	1510	-22
3个月期限	7.0573	7.0208	7.0446	-108	1525	-1
6个月期限	7.0765	7.0323	7.0626	-135	1650	90
1年期限	7.1165	7.0748	7.0876	-265	1830	170

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。