

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年12月9日-12月13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13日）报7.0156，较前周升值约0.32%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.72%，上周最高6.9570、最低7.0438，收于6.9839，波幅为1.24%。上周境内人民币汇率呈现震荡升值走势。预计本周人民币汇率或将呈现区间震荡格局，交投区间主要集中在6.9500-7.0500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点震荡上行。上周一（12月9日），市场资金面偏紧，各期限掉期点小幅上行；上周二（12月10日），受银行间市场买盘增多影响，各期限掉期点延续上行走势；上周三（12月11日），市场资金面均衡偏松，各期限掉期点小幅下行；上周四（12月12日），市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡；上周五，跨年未资金面紧张，各期限掉期点延续震荡走势。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与前周持平，上周最高454、最低425，收于443，波幅为6.55%。
- 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）较前周下行 164 个点，上周最高 7.1185、最低 6.9965，收于 7.0805，波幅为 1.72%。

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	-	-	7.0156	-227	-142	1524
银行间市场汇价	7.0438	6.9570	6.9839	-501	-422	1181
掉期点						
1 个月期限	86.50	0	85	4	11	85.55
2 个月期限	150	61	148.50	7.50	6.50	170.50
3 个月期限	190	0	187	7	1	224
6 个月期限	294	28	288.50	8.5	13.50	402.50
1 年期限	454	425	443	0	-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	7.0427	6.9260	7.0065	-174	1244	141
2 个月期限	7.0507	6.9330	7.0145	-169	1274	157.50
3 个月期限	7.0575	6.9390	7.0205	-176	1284	179
6 个月期限	7.0757	6.9585	7.0400	-179	1424	272.50
1 年期限	7.1185	6.9965	7.0805	-164	1759	523

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。