

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年12月16日-12月20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20日）报7.0020，较前周升值约0.19%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.39%，上周最高6.9922、最低7.0165，收于7.0115，波幅为0.35%。上周境内人民币汇率呈现窄幅震荡走势。预计本周人民币汇率或仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在6.9900-7.0500。
- 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16日），市场资金面偏紧，各期限掉期点小幅上行；上周二（12月17日），市场资金面持续紧张，各期限掉期点延续上行走势；上周三（12月18日），市场交投一般活跃，央行重启逆回购操作，并下调14天期逆回购操作利率，各期限掉期点有所下行；上周四（12月19日），市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡；上周五，受央行持续公开市场操作影响，资金面整体宽松，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上行21个点，上周最高488.5、最低77，收

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。

于 464，波幅为 88.69%。

- 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 54 个点，上周最高 7.0965、最低 7.0542，收于 7.0751，波幅为 0.60%。

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	-	-	7.0020	-136	-278	1388
银行间市场汇价	7.0165	6.9922	7.0115	276	-146	1457
掉期点						
1 个月期限	115	0	110	25	36	110.55
2 个月期限	166	0	153.52	5.02	11.52	175.52
3 个月期限	208	0	189	2	3	226
6 个月期限	318.50	31	298	9.50	23	412
1 年期限	488.50	77	464	21	19	741

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	7.0295	6.9735	7.0078	13	1257	-147
2 个月期限	7.0375	6.9805	7.0143	-2	1272	-125.52
3 个月期限	7.0320	6.9865	7.0198	-7	1277	-106
6 个月期限	7.0497	7.0055	7.0390	-10	1414	-23
1 年期限	7.0965	7.0542	7.0751	-54	1705	172

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。