

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年12月23日-12月27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27日）报6.9879，较前周升值约0.20%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.18%，上周最高6.9818、最低7.0146，收于6.9992，波幅为0.47%。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仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在6.9600-7.0200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点区间震荡。上周一（12月23日），受央行连续开展公开市场操作影响，市场资金面整体宽松，各期限掉期点小幅下行；上周二（12月24日），市场资金面持续宽松，各期限掉期点延续下行走势；上周三（12月25日），市场交投一般活跃，受远期美元买盘增多影响，各期限掉期点震荡上行；上周四（12月26日），市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡；上周五，央行公开市场逆回购相继到期，市场资金面边际收紧，各期限掉期点震荡上行。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21个点，上周最高

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。

490、最低 26，收于 485，波幅为 95.67%。

- 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 154 个点，上周最高 7.0903、最低 7.0487，收于 7.0597，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	-	-	6.9879	-141	-419	1247
银行间市场汇价	7.0146	6.9818	6.9992	-123	-269	1334
掉期点						
1 个月期限	120	0	103.50	-6.50	29.50	104.05
2 个月期限	148	39	142	-11.52	0	164
3 个月期限	192	165	191	2	5	228
6 个月期限	298	0	293	-5	18	407
1 年期限	490	26	485	21	40	762

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	7.0185	6.9846	6.9912	-166	1091	-183.50
2 个月期限	7.0248	6.9888	6.9977	-166	1106	-157
3 个月期限	7.0305	6.9956	7.0042	-156	1121	-141
6 个月期限	7.0495	7.0106	7.0206	-184	1230	-79
1 年期限	7.0903	7.0487	7.0597	-154	1551	120

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。