

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年12月30日-2020年1月3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（2020年1月3日）报6.9681，较前周升值约0.28%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.40%，上周最高6.9590、最低6.9954，收于6.9716，波幅为0.52%。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6.9400-7.0000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行。上周一（2019年12月30日），元旦假期临近，市场交投较为清淡，各期限掉期点震荡下行；上周二（2019年12月31日），市场交投较为清淡，各期限掉期点窄幅波动；上周四（2020年1月2日），市场交投较为活跃，人民银行开年全面降准，带动各期限掉期点小幅下行；上周五，市场交投较为活跃，市场资金面整体宽松，各期限掉期点小幅震荡。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下行2个点，上周最高485、最低440，收于483，波幅为9.32%。

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277个点，上周最高7.1895、最低7.0149，收于7.0320，波幅为2.48%。

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	-	-	6.9681	-198	-81	-81
银行间市场汇价	6.9954	6.9590	6.9716	-276	54	54
掉期点						
1个月期限	85	63	69.50	-34	-8.50	-8.50
2个月期限	130	103	114	-28	-4	-4
3个月期限	175	47.50	158	-33	-7.50	-7.50
6个月期限	277	34	268	-25	3	3
1年期限	485	440	483	-2	25	25

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	6.9995	6.9535	6.9677	-235	51	-108.50
2个月期限	7.0045	6.9592	6.9732	-245	46	-98
3个月期限	7.0095	6.9630	6.9797	-245	46	-77
6个月期限	7.0300	6.9782	6.9959	-247	54	-25
1年期限	7.1895	7.0149	7.0320	-277	50	121

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。