

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年1月6日-1月10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（1月10日）报6.9351，较前周升值约0.48%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.61%，上周最高6.9191、最低6.9794，收于6.9290，波幅为0.87%。上周境内人民币汇率呈现宽幅震荡走势。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6.8500-6.9500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行。上周一（1月6日），受公开市场操作净回笼等因素影响，各期限掉期点冲高上行；上周二（1月7日），受资金面均衡等因素影响，各期限掉期点窄幅震荡；上周三（1月8日），受资金面边际收紧等影响，各期限掉期点小幅上行；上周四（1月9日），受美元买盘踊跃等因素影响，各期限掉期点震荡上行；上周五（1月10日），交投比较活跃，各期限掉期点小幅上行。截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行73个点，上周最高565、最低493，收于556，波幅为12.95%。

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569个点，上周最高7.0495、最低6.9742，收于6.9751，波幅为1.08%。

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	—	—	6.9351	-330	-411	-411
银行间市场汇价	6.9794	6.9191	6.9290	-426	-372	-372
掉期点						
1个月期限	75	54	57	-12.50	-21	-21
2个月期限	120	60	104	-10	-14	-14
3个月期限	170	110	145	-13	-20.50	-20.50
6个月期限	298	260	281	13	16	16
1年期限	565	493	556	73	98	98

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	6.9815	6.9127	6.9138	-539	-488	-210.00
2个月期限	6.9877	6.9127	6.9243	-489	-443	-152.00
3个月期限	6.9937	6.9235	6.9296	-501	-455	-140.00
6个月期限	7.0120	6.9335	6.9468	-491	-437	-104.00
1年期限	7.0495	6.9742	6.9751	-569	-519	-96.00

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。