

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2020年1月13日-1月17日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（1月17日）报6.8878，较上周升值约0.69%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周升值约1.03%，本周最高6.8527、最低6.9151，收于6.8585，波幅为0.91%。本周境内人民币汇率呈现震荡升值走势。预计下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。截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周上行77个点，本周最高643、最低580，收于633，波幅为9.95%。
- 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）较上周下行329个点，本周最高6.9995、最低6.9255，收于6.9422，波幅为1.07%。

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。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较上周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.8878	-473	-884	-884
银行间市场汇价	6.9151	6.8527	6.8585	-705	-1077	-1077
掉期点						
1个月期限	82	48	82	25	4	4
2个月期限	140	107	134.80	30.80	16.80	16.80
3个月期限	188	134	188	43	22.50	22.50
6个月期限	330	265	330	49	65	65
1年期限	640	514	633	77	175	175

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	较上周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1个月期限	6.9310	6.8580	6.8735	-403	-891	68.00
2个月期限	6.9390	6.8635	6.8787	-456	-899	67.20
3个月期限	6.9440	6.8687	6.8842	-454	-909	69.00
6个月期限	6.9570	6.8818	6.9022	-446	-883	107.00
1年期限	6.9995	6.9255	6.9422	-329	-848	204.00

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。