

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年9月2日-9月6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（9月6日）报7.0855，较前周升值约0.03%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.29%，上周最高7.1097、最低7.1854，收于7.1243，波幅为1.06%。受美元指数走软、国内降准预期增强等因素影响，上周境内人民币汇率区间震荡。预计本周人民币汇率或将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在7.0900-7.1500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈震荡走势。上周一（9月2日），银行间市场资金面较为宽松，掉期市场呈现下行走势；上周二（9月3日），远期购汇需求旺盛，掉期点快速上行；上周三（9月4日），资金面有所收紧，掉期市场小幅上行；上周四（9月5日），市场交投比较冷清，各期限掉期点维持区间震荡；上周五，市场卖盘相对活跃，各期限掉期点震荡下行。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3个点，上周最高251、最低196，收于228，波幅为24.12%。

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420个点，上周最高7.2683、最低7.1533，收于7.1660，波幅为1.60%。

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	-	-	7.0855	-24	-24	2223
银行间市场汇价	7.1097	7.1854	7.1243	-209	-209	2585
掉期点						
1个月期限	35	0	30	-1	-1	30.55
2个月期限	57	23	50	-1.1	-1.1	72
3个月期限	82	0	75	0	0	112
6个月期限	182	0	35	-100	-100	149
1年期限	285	196	228	3	3	505

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	7.1813	7.0713	7.0835	-610	2014	-458.00
2个月期限	7.2038	7.0871	7.0990	-590	2119	-303.00
3个月期限	7.2163	7.0981	7.1105	-590	2184	-213.00
6个月期限	7.2383	7.1206	7.1320	-454	2344	42.00
1年期限	7.2683	7.1533	7.1660	-420	2614	189.00

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。