

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年9月9日-9月12日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周四（9月12日）报7.0846，较前周升值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.51%，上周最高7.0660、最低7.1351，收于7.0882，波幅为0.97%。受美元指数相对强势、中美贸易谈判乐观预期等因素影响，上周境内人民币汇率先贬后升。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7.0600-7.1100。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈窄幅震荡上行走势。上周一（9月9日），银行间资金面较为紧张，掉期点小幅上行；上周二（9月10日），远期美元买盘需求旺盛，掉期点快速上行；上周三（9月11日），资金面有所宽松，掉期点窄幅震荡交投；上周四（9月12日），部分境外机构美元买盘较为活跃，掉期点震荡上行。截至上周四16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行53个点，上周最高300、最低230，收于281，波幅为24.91%。

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515个点，上周最高7.1943、最低7.0952，收于7.1145，波幅为1.39%。

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	-	-	7.0846	-9	-33	2214
银行间市场汇价	7.1351	7.0660	7.0882	-361	-570	2224
掉期点						
1个月期限	33	24	24	-6	-7	24.55
2个月期限	55	0	48	-2	-3.10	70
3个月期限	81.50	0	70	-5	-5	107
6个月期限	153	0	145	110	10	259
1年期限	300	230	281	53	56	558

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	7.1058	7.0267	7.0439	-396	1618	-467.00
2个月期限	7.1273	7.0342	7.0509	-481	1638	-421.00
3个月期限	7.1373	7.0414	7.0579	-526	1658	-373.00
6个月期限	7.1583	7.0499	7.0799	-521	1823	-228.00
1年期限	7.1943	7.0952	7.1145	-515	2099	-18.00

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。