

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2019年9月23日-9月27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（9月27日）报7.0731，与上周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周贬值约0.41%，本周最高7.1020、最低7.1384，收于7.1195，波幅为0.51%。受中美贸易前景仍存不确定性、风险事件频发等因素影响，本周境内人民币汇率震荡贬值。预计下周人民币汇率可能仍维持区间震荡格局，交投区间主要集中在7.0800-7.1400。
- 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。本周一（9月23日），银行间市场资金面前紧后松，各期限掉期点小幅上行；本周二（9月24日），银行间市场资金面均衡偏松，各期限掉期点小幅下行；本周三（9月25日），远期美元买盘活跃，各期限掉期点震荡上行；本周四（9月26日），部分境外机构卖盘较为活跃，各期限掉期点震荡下行；本周五（9月27日），市场多空博弈，各期限掉期点小幅震荡。截至本周五16:30，中长期期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周上行23个点，本周最高

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。

370、最低 320，收于 345，波幅为 14.49%。

- 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）较上周上行 92 个点，本周最高 7.2150、最低 7.1520，收于 7.1997，波幅为 0.88%。

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	-	-	7.0731	1	-148	2099
银行间市场汇价	7.1384	7.1020	7.1195	294	-257	2537
掉期点						
1 个月期限	46.5	0	30	-4	-1	30.55
2 个月期限	77	30.75	62	-1	10.9	84
3 个月期限	107	0	94	11	19	131
6 个月期限	210.5	0	179	15	44	293
1 年期限	370	320	345	23	120	622

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	7.1312	7.0734	7.1145	565	2324	-80.00
2 个月期限	7.1470	7.0844	7.1312	657	2441	55.00
3 个月期限	7.1575	7.0930	7.1417	687	2496	128.00
6 个月期限	7.1785	7.1155	7.1627	632	2651	253.00
1 年期限	7.2150	7.1520	7.1997	722	2951	457.00

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。