

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年10月21日-10月25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（10月25日）报7.0749，较前周贬值约0.08%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.15%，上周最高7.0930、最低7.0560，收于7.0716，波幅为0.52%。上周境内人民币汇率维持窄幅区间震荡走势。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在7.0100-7.0800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈小幅震荡走势。上周一（10月21日），市场小幅高开，1年期掉期点维持在360-370区间窄幅震荡交投；上周二（10月22日），市场买卖力量相对均衡，各期限掉期点小幅震荡；上周三（10月23日），受资金面宽松等因素影响，各期限掉期点相较前日下行；上周四（10月24日），市场交投较活跃，受人民币买盘带动，各期限掉期点小幅上行；上周五，市场交投相对清淡，各期限掉期点震荡交投。截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行11个点，上周最高370、最低285，收于330，波幅为25.76%。

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218个点，上周最高7.1475，最低7.0950，收于7.1071，波幅为0.74%。

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	-	-	7.0749	59	20	2117
银行间市场汇价	7.0930	7.0560	7.0716	-109	-764	2058
掉期点						
1个月期限	53.5	0	42	-4	42	42.55
2个月期限	92	0	80	-4	80	102
3个月期限	145	0	133	10	133	170
6个月期限	236	0	207	0	207	321
1年期限	377	64	335	-6	-15	612

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	7.0750	7.0320	7.0421	-183	1600	-337.00
2个月期限	7.0855	7.0422	7.0491	-195	1620	-305.00
3个月期限	7.0945	7.0487	7.0556	-205	1635	-293.00
6个月期限	7.1130	7.0667	7.0740	-219	1764	-183.00
1年期限	7.1475	7.0950	7.1071	-218	2025	20.00

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。