

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年6月24日-6月28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（6月28日）报6.8747，较前周贬值约0.40%。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6.8593、最低6.8927，收于6.8650，波幅为0.49%。受市场对二十国集团（G20）会议中美贸易磋商前景不确定性等因素影响，上周境内人民币汇率呈震荡走势。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6.8600-6.9000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，各期限掉期点呈区间震荡走势。上周一（6月24日），市场交投比较活跃，各期限掉期点窄幅震荡；上周二（6月25日），市场交投一般活跃，资金面整体宽松，各期限掉期点有所回落；上周三（6月26日），市场交投一般活跃，市场观望情绪浓厚，各期限掉期点窄幅震荡；上周四（6月27日），市场交投一般活跃，各期限掉期点与前一交易日基本持平；上周五，市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡下行。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下行97个点，上周

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。

最高 243、最低 130，收于 138，波幅为 81.88%。

- 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 36 个点，上周最高 6.9380、最低 6.8962，收于 6.9114，波幅为 0.60%。

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	-	-	6.8747	275	-245	115
银行间市场汇价	6.8927	6.8593	6.8650	-100	-370	-8
掉期点						
1 个月期限	-1	-12.50	-3	10.50	-5	-2.45
2 个月期限	0	-10	-3.50	9.50	-11.50	18.50
3 个月期限	1.51	-11	-2.50	8.50	-21	34.50
6 个月期限	39	0	26	-2	-42	140
1 年期期限	243	130	138	-97	-140	415

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	6.8848	6.8450	6.8574	16	-247	-73.00
2 个月期限	6.8903	6.8485	6.8619	-2	-252	-27.50
3 个月期限	6.8983	6.8535	6.8674	-9	-247	26.50
6 个月期限	6.9187	6.8660	6.8816	-17	-160	140.00
1 年期期限	6.9380	6.8962	6.9114	-36	68	326.00

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。