

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年7月1日-7月5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（7月5日）报6.8697，较前周升值约0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.19%，上周最高6.8350、最低6.8945，收于6.8781，波幅为0.87%。受市场静待美国方面公布的非农数据影响，上周境内人民币汇率呈震荡走势。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在6.8600-6.8900。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈先下后上走势。上周一（7月1日），市场交投比较清淡，各期限掉期点略有下行；上周二（7月2日），银行间市场资金面整体宽松，各期限掉期点有所回落；上周三（7月3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（7月4日），市场交投活跃，各期限掉期点有所震荡；上周五，短端资金面略微收紧，各期限掉期点窄幅震荡上行。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23个点，上周最高145、最低20，收于115，

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。

波幅为 108.70%。

- 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）较前周上行 181 个点，上周最高 6.9380、最低 6.8607，收于 6.9295，波幅为 1.12%。

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 | - | - | 6.8697 | -50 | -50 | 65 |
| 银行间市场汇价 | 6.8945 | 6.8350 | 6.8781 | 131 | 131 | 123 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 1 个月期限 | 0 | -13 | -6.50 | -3.50 | -3.50 | -5.95 |
| 2 个月期限 | 0 | -14.60 | -8 | -4.50 | -4.50 | 14 |
| 3 个月期限 | 0.80 | -15 | -6.53 | -4.03 | -4.03 | 30.47 |
| 6 个月期限 | 25 | -2 | 22 | -4 | -4 | 136 |
| 1 年期期限 | 145 | 20 | 115 | -23 | -23 | 392 |

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 | 6.8875 | 6.8215 | 6.8810 | 236 | -11 | 35.50 |
| 2 个月期限 | 6.8910 | 6.8260 | 6.8850 | 231 | -21 | 77.00 |
| 3 个月期限 | 6.8953 | 6.8300 | 6.8885 | 211 | -36 | 110.53 |
| 6 个月期限 | 6.9085 | 6.8387 | 6.9005 | 189 | 29 | 202.00 |
| 1 年期期限 | 6.9380 | 6.8607 | 6.9295 | 181 | 249 | 399.00 |

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。