

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年7月8日-7月12日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（7月12日）报6.8662，较前周升值约0.05%。银行间外汇市场人民币对美元汇率与前周基本持平，上周最高6.8584、最低6.8956，收于6.8783，波幅为0.54%。上周境内人民币汇率维持区间震荡走势，波幅有所收窄。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：市场交投比较活跃，各期限掉期点呈先下后上走势。上周一（7月8日），市场交投活跃，受资金面整体宽松影响，各期限掉期点小幅震荡；上周二（7月9日），市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡下行；上周三（7月10日），市场交投比较清淡，各期限掉期点低位震荡；上周四（7月11日），市场交投较为活跃，各期限掉期点延续震荡态势；上周五，市场交投比较清淡，各期限掉期点震荡上行。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14个点，上周最高110、最低28，收于101，波幅为81.19%。

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145个点，上周最高6.9345、最低6.8906，收于6.9150，波幅为0.63%。

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	-	-	6.8662	-35	-85	30
银行间市场汇价	6.8956	6.8584	6.8783	2	133	125
掉期点						
1个月期限	0	-8.50	-2.50	4	0.50	-1.95
2个月期限	2.10	-10.50	-3	5	0.50	19
3个月期限	9.50	-11	-3	3.53	-0.50	34
6个月期限	28	0	12	-10	-14	126
1年期限	110	28	101	-14	-37	378

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	6.8855	6.8463	6.8675	-135	-146	-105.50
2个月期限	6.8888	6.8495	6.8710	-140	-161	-70.00
3个月期限	6.8920	6.8528	6.8740	-145	-181	-40.00
6个月期限	6.9027	6.8619	6.8857	-148	-119	62.00
1年期限	6.9345	6.8906	6.9150	-145	104	266.00

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。