

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年7月15日-7月19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19日）报6.8635，较前周升值约0.04%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.03%，上周最高6.8702、最低6.8833，收于6.8765，波幅为0.19%。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，各期限掉期点呈区间震荡走势。上周一（7月15日），市场交投活跃，受资金面边际收敛影响，各期限掉期点震荡上行；上周二（7月16日），市场交投比较活跃，受央行公开市场操作投放流动性影响，各期限掉期点冲高回落；上周三（7月17日），市场交投比较活跃，央行持续投放流动性，各期限掉期点震荡下行；上周四（7月18日），市场交投较为活跃，市场买卖盘力量相对均衡，各期限掉期点区间震荡；上周五，市场交投比较清淡，全天买盘力量较弱，各期限掉期点小幅下行。截至上周五16:30，中长期期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周

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。

下行 31 个点，上周最高 138、最低 70，收于 70，波幅为 97.14%。

- 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 64 个点，上周最高 6.9257、最低 6.9018，收于 6.9214，波幅为 0.35%。

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	-	-	6.8635	-27	-112	3
银行间市场汇价	6.8833	6.8702	6.8765	-18	115	107
掉期点						
1 个月期限	7.50	-0.80	7.30	9.80	10.30	7.85
2 个月期限	9.50	-1	7.60	10.60	11.10	29.60
3 个月期限	9.50	-1	3	6	5.50	40
6 个月期限	33	0	19	7	-7	133
1 年期限	138	70	70	-31	-68	347

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	6.8797	6.8568	6.8769	94	-52	-3.30
2 个月期限	6.8822	6.8603	6.8789	79	-82	16.40
3 个月期限	6.8855	6.8633	6.8814	74	-107	46.00
6 个月期限	6.8968	6.8610	6.8924	67	-52	140.00
1 年期限	6.9257	6.9018	6.9214	64	168	379.00

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。