

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年7月22日-7月26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26日）报6.8796，较前周贬值约0.23%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.05%，上周最高6.8695、最低6.8848，收于6.8798，波幅为0.22%。上周境内人民币汇率维持区间震荡走势，波幅仍然较窄。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6.8600-6.9000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点呈震荡上行走势。上周一（7月22日），市场交投活跃，资金面略显宽松，各期限掉期点小幅震荡下行；上周二（7月23日），受央行公开市场操作净回收流动性影响，资金面边际收紧，各期限掉期点有所上行；上周三（7月24日），市场交投比较活跃，全天市场延续震荡上行走势；上周四（7月25日），市场交投较为活跃，资金面有所收敛，各期限掉期点快速上行；上周五，市场交投活跃，各期限掉期点区间震荡。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上行68个点，上周最高140、最低40，收于138，波幅为72.46%。

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19个点，上周最高6.9280、最低6.9032，收于6.9195，波幅为0.36%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.8796	161	49	164
银行间市场汇价	6.8848	6.8695	6.8798	33	148	140
<b>掉期点</b>						
1个月期限	38.70	0	8	0.70	11	8.55
2个月期限	38.70	0	13.40	5.80	16.90	35.40
3个月期限	38.70	1	14.50	11.50	17	51.50
6个月期限	51.50	0	44	25	18	158
1年期限	140	40	138	68	0	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	6.8845	6.8605	6.8770	1	-51	-36.00
2个月期限	6.8860	6.8620	6.8782	-7	-89	-29.40
3个月期限	6.8880	6.8642	6.8805	-9	-116	-7.50
6个月期限	6.8991	6.8742	6.8910	-14	-66	68.00
1年期限	6.9280	6.9032	6.9195	-19	149	259.00

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。