

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年7月29日-8月2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（8月2日）报6.8996，较前周贬值约0.29%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.89%，上周最高6.8779、最低6.9502，收于6.9416，波幅为1.04%。受美元指数区间震荡、客盘交投均衡等因素影响，上周境内人民币汇率呈窄幅震荡走势。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6.9000-7.2000。
- 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29日），市场买卖均衡，各期限掉期点窄幅区间震荡；上周二（7月30日），市场交投较为活跃，各期限掉期点有所上行；上周三（7月31日），市场交投比较活跃，各期限掉期点冲高回落；上周四（8月1日），市场买卖均衡，各期限掉期点维持震荡；上周五，市场交投一般活跃，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80个点，上周最高220、最低99，收于218，波幅为55.50%。

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）较前周上涨944个点，上周最高7.0317、最低6.9110，收于7.0139，波幅为1.72%。

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	-	-	6.8996	200	155	364
银行间市场汇价	6.8779	6.9502	6.9416	618	561	758
掉期点						
1个月期限	22	5.5	22	14	10.6	22.55
2个月期限	33	8	30	16.6	4	52
3个月期限	45	0	42	27.5	14	79
6个月期限	92	15	85	41	19	199
1年期限	220	99	218	80	50	495

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	6.9715	6.8690	6.9579	809	758	141.00
2个月期限	6.9755	6.8710	6.9659	877	788	213.00
3个月期限	6.9800	6.8733	6.9719	914	798	261.00
6个月期限	7.0027	6.8815	6.9853	943	877	352.00
1年期限	7.0317	6.9110	7.0139	944	1093	505.00

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。