

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年8月5日-8月9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9日）报7.0136，较前周贬值约1.63%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.57%，上周最高6.9951、最低7.0699，收于7.0520，波幅为1.06%。受中美贸易紧张局势升温、市场美元买盘推动等因素影响，上周境内人民币汇率呈震荡贬值走势。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7.0100-7.0900。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投非常活跃，上周一（8月5日），远期美元买盘推动，各期限掉期点震荡上行；上周二（8月6日），交易商获利了结，各期限掉期点高位回落；上周三（8月7日），市场资金面边际趋紧，各期限掉期点震荡上行；上周四（8月8日），中美国债利差展宽，各期限掉期点窄幅震荡上行；上周五，市场买卖盘力量均衡，各期限掉期点窄幅震荡交投。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77个点，上周最高395、最低200，收于295，波幅为66.10%。

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1304个点，上周最高7.1894、最低6.9986，收于7.1443，波幅为2.67%。

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	-	-	7.0136	1140	1295	1504
银行间市场汇价	7.0699	6.9951	7.0520	1104	1665	1862
掉期点						
1个月期限	38	8	21	-1	9.60	21.55
2个月期限	63	0	46	16	20	68
3个月期限	85	0	63	21	35	100
6个月期限	176	57	127	42	61	241
1年期限	395	200	295	77	127	572

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	7.1358	6.9485	7.0813	1234	1992	272.00
2个月期限	7.1404	6.9546	7.0908	1249	2037	342.00
3个月期限	7.1492	6.9578	7.0993	1274	2072	410.00
6个月期限	7.1605	6.9692	7.1123	1270	2147	476.00
1年期限	7.1894	6.9986	7.1443	1304	2397	635.00

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。