

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年8月12日-8月16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16日）报7.0312，较前周贬值约0.25%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.11%，上周最高7.0096、最低7.0707，收于7.0446，波幅为0.87%。受市场美元买盘推动、中美贸易摩擦持续发酵等因素影响，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12日），资金面边际趋紧，各期限掉期点震荡上行；上周二（8月13日），受缴税等因素影响，市场资金面均衡偏紧，各期限掉期点继续上行；上周三（8月14日），市场资金面趋紧情况有所缓解，各期限掉期点小幅下行；上周四（8月15日），市场买盘较为活跃，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。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上行15个点，上周最高320、最低260，收于310，波幅为

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。

19.35%。

- 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453个点，上周最高7.1640、最低7.0396，收于7.0990，波幅为1.75%。

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	-	-	7.0312	176	1471	1680
银行间市场汇价	7.0707	7.0096	7.0446	-74	1591	1788
<b>掉期点</b>						
1个月期限	33	20	26	5	14.60	26.55
2个月期限	62.30	40	54	8	28	76
3个月期限	87.43	0	82	19	54	119
6个月期限	160	0	155	28	89	269
1年期限	320	260	310	15	142	587

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	7.0980	6.9712	7.0354	-459	1533	-118.00
2个月期限	7.1080	6.9820	7.0444	-464	1573	-56.00
3个月期限	7.1170	6.9930	7.0524	-469	1603	-4.00
6个月期限	7.1370	7.0100	7.0710	-413	1734	109.00
1年期限	7.1640	7.0396	7.0990	-453	1944	234.00

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。