

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年8月19日-8月23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23日）报7.0572，较前周贬值约0.37%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.54%，上周最高7.0385、最低7.0992，收于7.0825，波幅为0.86%。受LPR报价方式改革后贷款报价利率小幅降低、美元买盘推动等因素影响，上周境内人民币汇率震荡贬值。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7.1200-7.1600。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，上周一（8月19日），市场买卖盘力量相对均衡，各期限掉期点窄幅震荡；上周二（8月20日），LPR利率降低，各期限掉期点小幅下行；上周三（8月21日），市场买盘支撑，各期限掉期点小幅上行；上周四（8月22日），市场交投冷清，各期限掉期点区间震荡；上周五（8月23日），市场卖盘相对活跃，各期限掉期点震荡下行。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下行62个点，上周最高294、最低230，收于248，波幅为25.81%。

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）较前周上行938个点，上周最高7.2055、最低7.0925，收于7.1928，波幅为1.57%。

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	-	-	7.0572	260	1731	1940
银行间市场汇价	7.0992	7.0385	7.0825	379	1970	2167
掉期点						
1个月期限	29.75	15	23	-3	11.60	23.55
2个月期限	58	0	48	-6	22	70
3个月期限	84	0	69.50	-12.50	41.50	106.50
6个月期限	155	0	130	-25	64	244
1年期限	294	230	248	-62	80	525

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	7.1317	7.0280	7.1238	884	2417	390.00
2个月期限	7.1430	7.0370	7.1353	909	2482	480.00
3个月期限	7.1510	7.0452	7.1428	904	2507	533.50
6个月期限	7.1715	7.0586	7.1607	897	2631	652.00
1年期限	7.2055	7.0925	7.1928	938	2882	855.00

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。