

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年8月26日-8月30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30日）报7.0879，较前周贬值约0.43%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.88%，上周最高7.1319、最低7.1711，收于7.1452，波幅为0.55%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受中美两国加征关税、交易商买入美元等因素影响。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7.1200-7.1900。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，掉期点短端上行、长端下行。上周一（8月26日），市场远期美元买盘踊跃，各期限掉期点窄幅震荡；上周二（8月27日），市场资金面整体均衡，各期限掉期点窄幅震荡；上周三（8月28日），市场资金面边际宽松，各期限掉期点小幅下行；上周四（8月29日），市场交投比较清淡，各期限掉期点区间震荡；上周五，市场交投一般活跃，市场买盘相对活跃，各期限掉期点震荡上行。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下行23个点，上周最高305、最低218，

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。

收于 225，波幅为 38.67%。

- 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 152 个点，上周最高 7.2452、最低 7.1875，收于 7.2080，波幅为 0.80%。

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	-	-	7.0879	307	2038	2247
银行间市场汇价	7.1711	7.1319	7.1452	627	2597	2794
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	36	28	31	8	19.60	31.55
2 个月期限	62	50	51.10	3.10	25.10	73.10
3 个月期限	90	0	75	5.50	47	112
6 个月期限	160	0	135	5	69	249
1 年期限	305	218	225	-23	57	502

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	7.1703	7.1163	7.1445	207	2624	-38.00
2 个月期限	7.1838	7.1200	7.1580	227	2709	76.90
3 个月期限	7.1923	7.1377	7.1695	267	2774	168.00
6 个月期限	7.2120	7.1561	7.1774	167	2798	187.00
1 年期限	7.2452	7.1875	7.2080	152	3034	403.00

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。