

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年10月28日-11月1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（11月1日）报7.0437，较前周升值约0.44%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.48%，上周最高7.0310、最低7.0699，收于7.0376，波幅为0.55%。上周境内人民币汇率维持区间震荡走势。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在7.0100-7.1000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡上行。上周一（10月28日），市场小幅震荡，1年期掉期点维持在320-340区间窄幅震荡交投；上周二（10月29日），受中美利差展宽影响，各期限掉期点快速上行；上周三（10月30日），受市场看好中美两国贸易磋商前景影响，各期限掉期点维持高位震荡；上周四（10月31日），市场交投比较清淡，受资金面边际转松影响，各期限掉期点高位回落；上周五，市场交投一般活跃，人民币买盘力量相对踊跃，各期限掉期点低开后上行。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上行45个点，上周最高400、

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。

最低 316，收于 375，波幅为 22.40%。

- 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 31 个点，上周最高 7.1308，最低 7.0892，收于 7.1102，波幅为 0.59%。

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	-	-	7.0437	-312	-96	1805
银行间市场汇价	7.0699	7.0310	7.0376	-340	26	1718
掉期点						
1 个月期限	54	0	49	7	-1	49.55
2 个月期限	105	0	99	19	0	121
3 个月期限	155	0	142	9	2	179
6 个月期限	250	0	233	26	5	347
1 年期限	400	316	375	45	10	652

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	7.0660	7.0242	7.0412	-9	1591	-13.00
2 个月期限	7.0720	7.0302	7.0482	-9	1611	7.00
3 个月期限	7.0795	7.0360	7.0542	-14	1621	24.00
6 个月期限	7.0980	7.0553	7.0732	-8	1756	123.00
1 年期限	7.1308	7.0892	7.1102	31	2056	359.00

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。