

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年9月16日-9月20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（9月20日）报 7.0730，较前周升值约 0.16%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.03%，上周最高 7.0614、最低 7.1088，收于 7.0901，波幅为 0.65%。受市场买卖盘相对活跃等因素影响，上周境内人民币汇率震荡贬值。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在 7.0800-7.1400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈窄幅震荡上行走势。上周一（9月16日），银行间市场买卖盘力量均衡，各期限掉期点区间震荡；；上周二（9月17日），央行缩量续作 MLF 操作，市场资金面偏紧，各期限掉期点快速上行；上周三（9月18日），美元买盘相对活跃，各期限掉期点震荡上行；上周四（9月19日），部分境外机构买盘较为活跃，各期限掉期点震荡上行；上周五（9月20日），银行间市场资金面略显紧张，各期限掉期点小幅上行。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 41 个点，上周最高 340、最低 270，收于 322，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。

21.74%。

- 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130个点，上周最高7.1389、最低7.1105，收于7.1275，波幅为0.40%。

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	-	-	7.0730	-116	-149	2098
银行间市场汇价	7.1088	7.0624	7.0901	19	-551	2243
<b>掉期点</b>						
1个月期限	36.50	0	34	10	3	34.55
2个月期限	63	28	63	15	11.90	85
3个月期限	91	0	83	13	8	120
6个月期限	173	77	164	19	29	278
1年期限	340	270	322	41	97	599

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	7.0645	7.0405	7.0580	141	1759	-355
2个月期限	7.0743	7.0475	7.0655	146	1784	-309
3个月期限	7.0818	7.0550	7.0730	151	1809	-254
6个月期限	7.1028	7.0765	7.0995	196	2019	-70
1年期限	7.1389	7.1105	7.1275	130	2229	52

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。