

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年10月8日-10月11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（10月11日）报7.0727，与9月30日基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月30日升值约0.68%，上周最高7.0870、最低7.1533，收于7.1000，波幅为0.93%。上周境内人民币汇率维持维持震荡升值走势。预计本周人民币汇率或将呈震荡升值格局，交投区间主要集中在7.0100-7.0800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点呈震荡上行走势。上周二（10月8日），市场小幅高开，1年期掉期点维持在360-380的区间窄幅震荡交投；上周三（10月9日），市场买卖力量均衡，各期限掉期点区间震荡；上周四（10月10日），受中美利差展宽影响，各期限掉期点有所上行；上周五，市场交投比较活跃，1年期掉期点维持在400-410的区间窄幅震荡交投。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9月30日上行50个点，上周最高453、最低0，收于400，波幅为113.25%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较 9 月 30 日下行 577 个点，上周最高 7.2256、最低 7.1233，收于 7.1458，波幅为 1.43%。

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	-	-	7.0727	-2	-2	2095
银行间市场汇价	7.1533	7.0870	7.1000	-480	-480	2342
掉期点						
1 个月期限	45	0	43	13	13	43.55
2 个月期限	85	70	79	9	9	101
3 个月期限	129	0	128	34	34	165
6 个月期限	230	0	230	48	48	344
1 年期限	453	0	400	50	50	677

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	7.1415	7.0524	7.0708	-497	1887	-335
2 个月期限	7.1575	7.0638	7.0828	-512	1957	-251
3 个月期限	7.1685	7.0720	7.0918	-532	1997	-210
6 个月期限	7.1895	7.0926	7.1112	-543	2136	-118
1 年期限	7.2256	7.1233	7.1458	-577	2412	58

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。