工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2018 年 11 月 19 日-11 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（11 月 23 日）报 6.9306，较前周升值约 0.10%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.08%，上周最高 6.9219、最低 6.9514，收于 6.9421，波幅为 0.42%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势。预计本周人民币汇率可能维持宽幅震荡格局，交投区间主要集中在 6.9000-6.9700。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，呈区间震荡走势。上周一（11 月 19 日），央行暂停逆回购操作，市场交投清淡，各期限掉期点窄幅震荡；上周二（11 月 20 日），市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅上行；上周三（11 月 21 日），市场买卖盘力量均衡，各期限掉期点冲高回落；上周四（11 月 22 日），各期限掉期点延续震荡态势；上周五，市场交投一般活跃，流动性一般，长端掉期点小幅下行。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跌 10 个点，上周最高-221、最低-275，收于-265，波幅为 20.38%。
- 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）较前周上涨 222 个点，上周最高 7.0140、最低 6.9735，收于 7.0040，波幅为 0.58%。

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	-	-	6.9306	-71	-340	3964
银行间市场汇价	6.9514	6.9219	6.9421	-53	-319	4301
掉期点						
1 个月期限	1	-3	0	4	-6	-116
2 个月期限	7.50	-8	-3	-1	-10	-243
3 个月期限	-4.50	-35	-19	1	-29	-346
6 个月期限	-62	-88	-84	-5	-72	-659
1 年期限	-221	-275	-265	-10	-185	-1263

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	6.9565	6.9245	6.9488	248	4277	67
2 个月期限	6.9663	6.9318	6.9588	250	4230	170
3 个月期限	6.9750	6.9420	6.9673	243	4191	271
6 个月期限	6.9925	6.9525	6.9838	243	4009	501
1 年期限	7.0140	6.9735	7.0040	222	3545	884

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。