

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年1月14日-1月18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（1月18日）报6.7665，较前周升值约0.36%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.33%，上周最高6.7340、最低6.7820，收于6.7706，波幅为0.71%。上周境内人民币汇率呈宽幅震荡走势，主要集中在6.7340-6.7820。预计本周人民币汇率阻力位6.7200，支撑位6.8000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃程度一般，呈先抑后扬走势。上周前两个交易日，市场逐渐消化央行实施全面降准的消息，长端掉期点震荡下行；上周随后三个交易日，月中缴税等因素导致资金面偏紧，长端掉期点有所上行。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涨3个点，上周最高-210、最低-292，收于-230，波幅为35.65%。
- 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）较前周上涨424个点，上周最高6.8395、最低6.7570，收于6.8291，波幅为1.21%。

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。

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	-	-	6.7665	-244	-967	-967
银行间市场汇价	6.7820	6.7340	6.7706	224	-952	-952
掉期点						
1 个月期限	0.90	-5	-2	1	-1.45	-1.45
2 个月期限	11	-28	-20.50	1.50	1.50	1.5
3 个月期限	0	-58	-43	7	-6	-6
6 个月期限	-68	-137	-107	-2	7	7
1 年期限	-210	-292	-230	3	47	47

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	6.8070	6.7370	6.8010	384	-811	306.00
2 个月期限	6.8130	6.7417	6.8056	384	-815	370.50
3 个月期限	6.8180	6.7472	6.8116	384	-805	453.00
6 个月期限	6.8260	6.7490	6.8184	399	-792	585.00
1 年期限	6.8395	6.7570	6.8291	424	-755	815.00

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。