

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年12月31日-2019年1月4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（2019年1月4日）报6.8586，较前周升值约0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.02%，上周最高6.8488、最低6.8833，收于6.8645，波幅为0.50%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势，主要集中在6.8518-6.8721。预计本周人民币汇率可能维持宽幅震荡格局。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃程度一般，呈区间震荡上行走势。上周三（2019年1月2日），交投比较清淡，资金面比较充裕，长端掉期点窄幅震荡；上周四（2019年1月3日），交投比较活跃，长端掉期点小幅震荡走升；上周五，市场交投比较清淡，各期限掉期点小幅震荡。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前周上涨8个点，上周最高-245、最低-315，收于-269，波幅为26.02%。
- 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）较前周下跌141个点，上周最高6.9175、最低6.8747，收于6.8905，波幅为0.62%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.8586	-46	-46	-46
银行间市场汇价	6.8488	6.8833	6.8645	-13	-13	-13
<b>掉期点</b>						
1个月期限	2	-15.1	-13.8	-13.25	-13.25	-13.25
2个月期限	-5.5	-31	-27.5	-5.5	-5.5	-5.5
3个月期限	0	-51	-40	-3	-3	-3
6个月期限	-80	-127	-111	3	3	3
1年期限	-245	-315	-269	8	8	8

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	6.8930	6.8575	6.8630	-191	-191	-1.20
2个月期限	6.8985	6.8615	6.8690	-181	-181	72.5
3个月期限	6.9040	6.8670	6.8750	-171	-171	145.00
6个月期限	6.9100	6.8700	6.8820	-156	-156	286
1年期限	6.9175	6.8747	6.8905	-141	-141	529.00

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。