

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年1月7日-1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（1月11日）报6.7909，较前周升值约0.99%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约1.69%，上周最高6.7375、最低6.8621，收于6.7482，波幅为1.85%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势，主要集中在6.7375-6.8621。预计本周人民币汇率阻力位6.7200，支撑位6.7800。
- 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。上周一（1月7日），交投比较清淡，1年期掉期点下行至-333一线；上周二（1月8日），1年期掉期点继续下行至-329；上周三（1月9日），央行继续暂停公开市场操作后资金面宽松边际有所收敛，一年掉期点上行至-275；上周四（1月10日），资金面持续有所收紧，一年掉期点上行至-255；上周五，市场卖压减弱，掉期点小幅上行。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36个点，上周最高-233、最低-370，收于-233，波幅为58.80%。
- 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）较前周下跌 1038 个点，上周最高 6.8980、最低 6.757，收于 6.7867，波幅为 2.08%。

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	-	-	6.7909	-677	-723	-723
银行间市场汇价	6.7375	6.8621	6.7482	-1163	-1176	-1176
掉期点						
1 个月期限	-1	-24	-3	10.8	-2.45	-2.45
2 个月期限	-15	-53	-22	5.5	0	0
3 个月期限	0	-90	-50	-10	-13	-13
6 个月期限	-72	-180	-105	6	9	9
1 年期限	-233	-370	-233	36	44	44

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	6.8725	6.7355	6.7626	-1004	-1195	147.00
2 个月期限	6.8785	6.7400	6.7672	-1018	-1199	212.00
3 个月期限	6.8835	6.7450	6.7732	-1018	-1189	300.00
6 个月期限	6.8900	6.7500	6.7785	-1035	-1191	408.00
1 年期限	6.8980	6.7570	6.7867	-1038	-1179	618.00

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。