

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年1月21日-1月25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25日）报6.7941，较前周贬值约0.41%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.10%，上周最高6.7560、最低6.8111，收于6.7640，波幅0.81%。上周境内人民币汇率呈跌后反弹走势。预计本周阻力位6.7000，支撑位6.8000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃程度一般，呈单边上行走势。上周一（1月21日），交投比较清淡，1年期掉期点围绕-250至-220区间交投；上周二（1月22日），1年期掉期点突破-200一线；上周三（1月23日），市场卖方力量不足，掉期点单边上行；上周四（1月24日），1年期掉期点上行至-100上方；上周五，市场低开高走，1年期掉期点重新回-100一线。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145个点，上周最高130.50、最低-245，收于-85，波幅441.76%。
- 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521个点，上周最

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。

高 6.8450、最低 6.7745，收于 6.7770，波幅 1.04%。

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	-	-	6.7941	276	-691	-691
银行间市场汇价	6.7560	6.8111	6.7640	-66	-1018	-1018
掉期点						
1 个月期限	7	-3	6	8	6.55	6.55
2 个月期限	-1	-28	-3	17.50	19	19
3 个月期限	2	-48.50	-14	29	23	23
6 个月期限	0	-114.50	-53	54	61	61
1 年期限	130.50	-245	-85	145	192	192

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	6.8140	6.7460	6.7475	-535	-1346	-171.00
2 个月期限	6.8195	6.7515	6.7530	-526	-1341	-107.00
3 个月期限	6.8245	6.7555	6.7570	-546	-1351	-56.00
6 个月期限	6.8323	6.7642	6.7657	-527	-1319	70.00
1 年期限	6.8450	6.7745	6.7770	-521	-1276	215.00

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。