

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2019年1月28日-2月1日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（2月1日）报6.7081，较上周升值约1.27%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周升值约0.37%，本周最高6.6900、最低6.7545，收于6.7391，波幅为0.96%。本周境内人民币汇率呈震荡升值走势。预计短期内人民币汇率可能维持震荡格局，交投区间主要集中在6.7000-6.7500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，呈冲高回落走势。本周一（1月28日），1年期掉期点围绕-120至-80区间交投；本周二（1月29日），市场买盘力量推升1年期掉期点快速上行；本周三（1月30日），市场买卖盘力量均衡，1年期掉期点上行至8的周内高位后迅速回落；本周终，央行重启逆回购操作，市场资金面相对宽松，1年期掉期点持续下行。截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周下跌50个点，本周最高8、最低-160，收于-135，波幅124.44%。
- 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）较上周下跌 16 个点，本周最高 6.7885、最低 6.7160，收于 6.7754，波幅 1.07%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

| | 最高价 | 最低价 | 收盘价 | 较上周 (点) | 较上月 末(点) | 较去年末 (点) |
|-------------|--------|--------|--------|------------|-------------|-------------|
| 即期汇率 | | | | | | |
| 中间价 | - | - | 6.7081 | -860 | 56 | -1551 |
| 银行间市场汇价 | 6.6900 | 6.7545 | 6.7391 | -249 | 336 | -1267 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 1 个月期限 | 23 | -7 | -1 | -7 | 1 | -0.45 |
| 2 个月期限 | 19 | -16 | -12 | -9 | -2 | 10 |
| 3 个月期限 | 18.5 | -30 | -26 | -12 | -6 | 11 |
| 6 个月期限 | 5 | -85 | -70 | -17 | -10 | 44 |
| 1 年期限 | 8 | -160 | -135 | -50 | -19 | 142 |

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 | 较上周 (点) | 较去年末 (点) | 与境内价差 (点) |
|--------|--------|--------|--------|------------|-------------|--------------|
| 1 个月期限 | 6.7615 | 6.6895 | 6.7468 | -7 | -1353 | 78 |
| 2 个月期限 | 6.7665 | 6.6950 | 6.7519 | -11 | -1352 | 140 |
| 3 个月期限 | 6.7705 | 6.7000 | 6.7564 | -6 | -1357 | 199 |
| 6 个月期限 | 6.7773 | 6.7035 | 6.7642 | -15 | -1334 | 321 |
| 1 年期限 | 6.7885 | 6.7160 | 6.7754 | -16 | -1292 | 498 |

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。