

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年2月11日-2月15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（2月15日）报6.7623，较2月1日贬值约0.81%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较2月1日贬值约0.61%，上周最高6.7508、最低6.7965，收于6.7802，波幅为0.95%。上周境内人民币汇率呈震荡贬值走势。预计本周人民币汇率阻力位6.7200，支撑位6.8500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅上行，掉期曲线较2月1日当周变陡上移。1年期掉期点在上周二（2月12日）突破春节前的-150至-100区间上沿，维持在-80至-40的窄幅区间震荡。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2月1日上涨78个点，上周最高-10、最低-150，收于-57，波幅为245.61%。
- 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2月1日上涨96个点，上周最高6.8293、最低6.7688，收于6.7850，波幅为0.89%。

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	-	-	6.7623	542	598	-1009
银行间市场汇价	6.7965	6.7508	6.7802	411	747	-856
掉期点						
1个月期限	4	-5	-1.1	-0.1	0.9	-0.55
2个月期限	-0.5	-10	-4.25	7.75	5.75	17.75
3个月期限	12	-28	-9	17	11	28
6个月期限	-5	-59	-30	40	30	84
1年期限	-10	-150	-57	78	59	220

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	6.7975	6.7462	6.7570	102	-1251	-230.90
2个月期限	6.8020	6.7505	6.7616	97	-1255	-181.75
3个月期限	6.8060	6.7550	6.7657	93	-1264	-136.00
6个月期限	6.8155	6.7594	6.7755	113	-1221	-17.00
1年期限	6.8293	6.7688	6.7850	96	-1196	105.00

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。