

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年2月18日-2月22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22日）报6.7151，较前周升值约0.70%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.91%，上周最高6.6920、最低6.7809，收于6.7186，波幅为1.32%。上周境内人民币汇率呈震荡升值走势。预计本周人民币汇率可能维持震荡升值走势，交投区间主要集中在6.6000-6.7000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，呈震荡上涨走势。上周一（2月18日），市场交投比较活跃，各期限掉期点有所下行；上周二（2月19日），各期限掉期点延续下行走势；上周三（2月20日），市场交投比较活跃，各期限掉期点有所上行；上周四（2月21日），各期限掉期点延续上行态势；上周五，市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡。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前周上涨7个点，上周最高10、最低-95，收于-50，波幅为210.00%。
- 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 636 个点，上周最高 6.8010、最低 6.6985，收于 6.7214，波幅为 1.52%。

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	-	-	6.7151	-472	126	-1481
银行间市场汇价	6.7809	6.6920	6.7186	-616	131	-1472
掉期点						
1 个月期限	2.80	-5	1.2	2.3	3.20	1.75
2 个月期限	0.10	-10.50	-5	-0.75	5	17
3 个月期限	1	-22	-7	2	13	30
6 个月期限	30	-50	-11.9	18.10	48.10	102.10
1 年期	10	-95	-50	7	66	227

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	6.7726	6.6805	6.6964	-606	-1857	-223.20
2 个月期限	6.7775	6.6838	6.7002	-614	-1869	-179.00
3 个月期限	6.7820	6.6882	6.7047	-610	-1874	-132.00
6 个月期限	6.7905	6.6892	6.7114	-641	-1862	-60.10
1 年期	6.8010	6.6985	6.7214	-636	-1832	78.00

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。