

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年2月25日-3月1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（3月1日）报6.6957，较前周升值约0.29%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.16%，上周最高6.6738、最低6.7099，收于6.7078，波幅为0.54%。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区间震荡走势，交投区间主要集中在6.6700-6.7400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，各期限掉期点呈区间震荡走势。上周一（2月25日），市场交投比较活跃，各期限掉期点小幅震荡上行；上周随后两个交易日，各期限掉期点延续上行走势；上周四（2月28日），市场交投比较活跃，各期限掉期点窄幅区间震荡；上周五，市场交投比较活跃，各期限掉期点小幅下行。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行25个点，上周最高0、最低-60，收于-25，波幅为240.00%。
- 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）较前周上行161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 6.7430、最低 6.6870，收于 6.7375，波幅为 0.83%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.6957	-194	56	-1675
银行间市场汇价	6.7099	6.6738	6.7078	-108	210	-1580
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	4.50	0	0.50	-0.70	-1.90	1.05
2 个月期限	4.99	-2.20	-2	3	-3.06	20
3 个月期限	2.99	-12	-4	3	-3.45	33
6 个月期限	-3	-33	-14	-2.10	-5.50	100
1 年期限	0	-60	-25	25	-12	252

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	6.7140	6.6665	6.7113	149	-1708	34.50
2 个月期限	6.7173	6.6702	6.7145	143	-1726	69.00
3 个月期限	6.7205	6.6737	6.7170	123	-1751	96.00
6 个月期限	6.7285	6.6770	6.7260	146	-1716	196.00
1 年期限	6.7430	6.6870	6.7375	161	-1671	322.00

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。