

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年3月11日-3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（3月15日）报6.7167，较前周升值约0.10%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.23%，上周最高6.7010、最低6.7301，收于6.7117，波幅为0.43%。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宽幅震荡走势，交投区间主要集中在6.6900-6.7400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点呈震荡上行走势。上周一（3月11日），市场交投比较活跃，各期限掉期点有所上行；上周随后三个交易日，市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡上行；上周五，市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅震荡。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行75个点，上周最高40、最低-43，收于29，波幅为286.21%。
- 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）较前周下行165个点，上周最高6.7645、最低6.7205，收于6.7405，波幅为0.65%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.7167	-68	266	-1465
银行间市场汇价	6.7301	6.7010	6.7117	-152	249	-1541
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	5	-5.80	4.10	3.49	1.70	4.65
2 个月期限	6.50	-2	6	9.50	4.94	28
3 个月期限	9.80	-9	5.50	15.50	6.05	42.50
6 个月期限	20	-25	17	43	25.50	131
1 年期限	40	-43	29	75	42	306

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	6.7337	6.6935	6.7103	-169	-1718	-18.10
2 个月期限	6.7380	6.6960	6.7132	-170	-1739	9
3 个月期限	6.7405	6.6990	6.7160	-169	-1761	37.50
6 个月期限	6.7480	6.7075	6.7250	-162	-1726	116
1 年期限	6.7645	6.7205	6.7405	-165	-1641	259

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。