

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年3月18日-3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（3月22日）报6.6944，较前周升值约0.33%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.08%，上周最高6.6689、最低6.7200，收于6.7060，波幅为0.76%。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6.6600-6.7200。
- 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18日），市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行；上周二（3月19日），市场交投比较活跃，各期限掉期点小幅震荡；上周三（3月20日），市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行；上周四（3月21日），市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行；上周五，市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行。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35个点，上周最高95、最低30，收于64，波幅为101.56%。
- 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）较前周上行 80 个点，上周最高 6.7567、最低 6.6913，收于 6.7485，波幅为 0.97%。

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	-	-	6.6944	-223	43	-1688
银行间市场汇价	6.7200	6.6689	6.7060	-57	192	-1598
掉期点						
1 个月期限	8.50	3.10	6.20	2.10	3.80	6.75
2 个月期限	13.50	0	8.10	2.10	7.04	30.10
3 个月期限	19	-9.50	9.60	4.10	10.15	46.60
6 个月期限	49	0	25	8	33.50	139
1 年期限	95	30	64	35	77	341

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	6.7254	6.6665	6.7175	72	-1646	108.80
2 个月期限	6.7282	6.6690	6.7205	73	-1666	136.90
3 个月期限	6.7312	6.6720	6.7235	75	-1686	165.40
6 个月期限	6.7400	6.6758	6.7325	75	-1651	240.00
1 年期限	6.7567	6.6913	6.7485	80	-1561	361.00

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。