

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年3月25日-3月29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29日）报6.7335，较前周贬值约0.58%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.21%，上周最高6.7002、最低6.7408，收于6.7204，波幅为0.60%。上周境内人民币汇率呈震荡走势。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6.7000-6.7400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，掉期曲线趋陡。上周一（3月25日），市场交投比较清淡，各期限掉期点震荡下行；上周随后三个交易日，市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行；上周五（3月29日），市场交投比较活跃，各期限掉期点有所下行。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56个点，上周最高190、最低50，收于120，波幅为116.67%。
- 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120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 6.7843、最低 6.7307，收于 6.7605，波幅为 0.79%。

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	-	-	6.7335	391	434	-1297
银行间市场汇价	6.7408	6.7002	6.7204	144	336	-1454
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	8	0	4	-2.20	1.60	4.55
2 个月期限	16	4.70	11	2.90	9.94	33
3 个月期限	25	5.10	14	4.40	14.55	51
6 个月期限	84	0	48	23	56.50	162
1 年期限	190	50	120	56	133	397

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	6.7460	6.7020	6.7195	20	-1626	-13.00
2 个月期限	6.7490	6.7050	6.7235	30	-1636	20.00
3 个月期限	6.7525	6.7080	6.7270	35	-1651	52.00
6 个月期限	6.7625	6.7152	6.7385	60	-1591	133.00
1 年期限	6.7843	6.7307	6.7605	120	-1441	281.00

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。