

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年6月17日-6月21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（6月21日）报6.8472，较前周升值约0.67%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.70%，上周最高6.8340、最低6.9316，收于6.8750，波幅为1.42%。上周受美元指数上涨乏力、市场供求均衡等因素影响，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继续维持震荡格局，交投区间主要集中在6.8500-6.8900。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行。上周一（6月17日），市场交投较为活跃，掉期点窄幅震荡；上周二（6月18日），市场资金面呈宽松态势，掉期点有所回落；上周三（6月19日），受央行连续资金净投放影响，掉期点小幅回落；上周四（6月20日），市场全天震荡，掉期点与前一交易日基本持平；上周五，资金面明显转松，掉期点震荡下行。截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行100个点，上周最高325、最低210，收于235，波幅为48.94%。

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。

- 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730个点，上周最高6.9957、最低6.8854，收于6.9150，波幅为1.60%。

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	-	-	6.8472	-465	-520	-160
银行间市场汇价	6.9316	6.8340	6.8750	-486	-270	92
<b>掉期点</b>						
1个月期限	2.2	-14	-13.5	-14	-15.5	-12.95
2个月期限	3.5	-15	-13	-18	-21	9
3个月期限	14	-13	-11	-25	-29.5	26
6个月期限	66	0	28	-46	-40	142
1年期限	325	210	235	-100	-43	512

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	6.9203	6.8290	6.8558	-544	-263	-178.50
2个月期限	6.9296	6.8350	6.8621	-576	-250	-116.00
3个月期限	6.9390	6.8415	6.8683	-609	-238	-56.00
6个月期限	6.9578	6.8532	6.8833	-666	-143	55.00
1年期限	6.9957	6.8854	6.9150	-730	104	165.00

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。