

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年5月21日-5月25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（5月25日）报6.3867，较前周贬值约0.16%。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6.3349、最低6.3955，收于6.3891，波幅为0.21%。上周主要受美元指数高位震荡、市场卖盘较重影响，境内人民币汇率小幅走贬。预计本周人民币汇率仍将呈双边震荡走势，阻力位6.3500、支撑位6.4200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，整体呈现冲高回落的走势。短期限方面，上周前三个交易日短期限掉期点小幅走升，日均掉期点基本维持在2上方，随后两个交易日有所回落至日均1.5的位置；中长期方面，上周前三个交易日从675逐步走升至740附近，随后两个交易日开始回落，上周五回到700一线震荡交投。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较前周上涨10个点，上周最高739、最低675，收于695，波幅为9.21%。
- 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）较前周上涨361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 6.4403，最低 6.5005，收于 6.4980，波幅为 0.93%。

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	—	—	6.3867	104	474	-1475
银行间市场汇价	6.3955	6.3649	6.3891	131	452	-1229
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	79	70	71.4	3.2	-0.6	-44.6
2 个月期限	162	141	146	6	13	-94
3 个月期限	235	200	208	3	19	-119
6 个月期限	410	372	383	1	17	-192
1 年期限	739	150	695	10	-7	-303

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	6.4090	6.3555	6.4075	250	-1136	112.6
2 个月期限	6.4202	6.3660	6.4195	260	-1163	158
3 个月期限	6.4305	6.3760	6.4295	260	-1187	196
6 个月期限	6.4555	6.4048	6.4472	271	-1357	198
1 年期限	6.5005	6.4403	6.4980	361	-1515	394

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。