

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年4月1日-4月4日)

## ◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周四（4月4日）报6.7055，较前周升值约0.42%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.03%，上周最高6.7010、最低6.7250，收于6.7185，波幅为0.36%。上周境内人民币汇率呈窄幅震荡走势。预计本周人民币汇率可能维持震荡走势，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，各期限掉期点震荡下行。上周一（4月1日），市场交投一般活跃，各期限掉期点宽幅震荡；上周二（4月2日），资金面持续宽松，各期限掉期点震荡下行；上周三（4月3日），远期购汇客盘活跃，推动掉期点小幅上行；上周四（4月4日），买卖盘力量均衡，各期限掉期点窄幅震荡。截至上周四16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行16个点，上周最高184、最低20，收于136，波幅为120.59%。
- 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96个点，上周最高

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。

6.7759、最低 6.7275，收于 6.7509，波幅为 0.72%。

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	-	-	6.7055	-280	-280	-1577
银行间市场汇价	6.7250	6.7010	6.7185	-19	-19	-1473
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	5.50	0	2.80	-1.20	-1.20	3.35
2 个月期限	10.15	3.50	6	-5	-5	28
3 个月期限	17	-5	9.50	-4.50	-4.50	46.50
6 个月期限	92	0	38	-10	-10	152
1 年期限	184	20	136	16	16	413

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	6.7345	6.694	6.7129	-66	-1692	-58.80
2 个月期限	6.7385	6.6975	6.7162	-73	-1709	-29.00
3 个月期限	6.7425	6.7015	6.7197	-73	-1724	2.50
6 个月期限	6.7535	6.7075	6.7306	-79	-1670	83.00
1 年期限	6.7759	6.7275	6.7509	-96	-1537	188.00

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。