

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019 年 4 月 15 日-4 月 19 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（4 月 19 日）报 6.7043，较前周升值约 0.26%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.17%，上周最高 6.6854、最低 6.7128，收于 6.7034，波幅为 0.41%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势。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 6.6800-6.7200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡。上周一（4 月 15 日），在好于预期的经济数据提振下，各期限掉期点有所上行；上周二（4 月 16 日），市场买卖力量均衡，各期限掉期点维持窄幅震荡；上周三（4 月 17 日），受流动性边际收紧影响，各期限掉期点有所上行；上周四（4 月 18 日），市场重新回到窄幅区间震荡行情；上周五，市场走势偏弱，流动性趋于宽松，各期限掉期点略有下行。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上行 2 个点，上周最高 186、最低 165，收于 170，波幅为 12.35%。

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 21 个点，上周最高 6.7515、最低 6.7100，收于 6.7402，波幅为 0.62%。

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	-	-	6.7043	-177	-292	-1589
银行间市场汇价	6.7128	6.6854	6.7034	-111	-170	-1624
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	5	0	3.40	-0.70	-0.60	3.95
2 个月期限	12	0	8.30	-0.20	-2.70	30.30
3 个月期限	21	0	15.80	-0.20	1.80	52.80
6 个月期限	65	40	55	3	7	169
1 年期限	186	165	170	2	50	447

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	6.7125	6.6725	6.7012	-41	-1809	-25.40
2 个月期限	6.7148	6.6755	6.7032	-54	-1839	-10.30
3 个月期限	6.7175	6.6785	6.7062	-51	-1859	12.20
6 个月期限	6.7275	6.6860	6.7152	-56	-1824	63.00
1 年期限	6.7515	6.7100	6.7402	-21	-1644	198.00

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。