

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年4月8日-4月12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12日）报6.7220，较前周贬值约0.25%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.06%，上周最高6.7090、最低6.7233，收于6.7145，波幅为0.21%。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6.6900-6.7400。
- 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8日），市场低开高走，各期限掉期点有所上行；上周二（4月9日），市场买卖力量均衡，各期限掉期点维持区间震荡；上周三（4月10日），受国债期货拉升影响，各期限掉期点从高位回落、震荡下行；上周四（4月11日），市场重新回到窄幅区间震荡行情；上周五，市场走势偏弱，尾盘各期限掉期点出现小幅反弹。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32个点，上周最高190、最低120，收于168，波幅为41.67%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行 86 个点，上周最高 6.7661、最低 6.7360，收于 6.7423，波幅为 0.45%。

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	-	-	6.7220	165	-115	-1412
银行间市场汇价	6.7233	6.7090	6.7145	-40	-59	-1513
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	5.30	2.50	4.10	1.30	0.10	4.65
2 个月期限	11.50	1	8.50	2.50	-2.50	30.50
3 个月期限	20	0	16	6.50	2	53
6 个月期限	64	26	52	14	4	166
1 年期限	190	120	168	32	48	445

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	6.7278	6.7003	6.7053	-76	-1768	-96.10
2 个月期限	6.7303	6.7036	6.7086	-76	-1785	-67.50
3 个月期限	6.7333	6.7063	6.7113	-84	-1808	-48.00
6 个月期限	6.7423	6.7158	6.7208	-98	-1768	11.00
1 年期限	6.7661	6.7360	6.7423	-86	-1623	110.00

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。