

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2019年4月22日-4月26日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价周五（4月26日）报6.7307，较上周贬值约0.39%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周贬值约0.52%，本周最高6.7500、最低6.7030，收于6.7381，波幅为0.70%。本周境内人民币汇率呈小幅震荡贬值走势。预计下周人民币汇率可能维持震荡走势，交投区间主要集中在6.6900-6.7600。
- 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。本周一（4月22日），买卖盘力量均衡，各期限掉期点小幅上行；本周二（4月23日），各期限掉期点在中美利差扩大带动下小幅上行；本周三（4月24日），受流动性边际收紧影响，各期限掉期点快速上行；本周四（4月25日），买卖盘力量均衡，各期限掉期点冲高回落；本周五（4月26日），市场流动性趋于宽松，各期限掉期点略有下行。截至周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周上行5个点，本周最高200、最低150，收于175，波幅为28.57%。

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）较上周上行321个点，本周最高6.7952、最低6.7329，收于6.7722，波幅为0.92%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较上周 (点)	较上月末 (点)	较去年末 (点)
即期汇率						
中间价	-	-	6.7307	264	-28	-1325
银行间市场汇价	6.7500	6.7030	6.7381	347	177	-1277
掉期点						
1个月期限	4.50	-2	0.60	-2.80	-3.40	1.15
2个月期限	11	2	3	-5.30	-8	25
3个月期限	18	0	12	-3.80	-2	49
6个月期限	62	0	52	-3	4	166
1年期限	200	150	175	5	55	452

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	较上周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1个月期限	6.7545	6.6905	6.7343	331	-1478	-38.60
2个月期限	6.7571	6.6935	6.7379	347	-1492	-5.00
3个月期限	6.7600	6.6965	6.7396	334	-1525	3.00
6个月期限	6.7695	6.7040	6.7485	333	-1491	52.00
1年期限	6.7952	6.7329	6.7723	321	-1323	167.00

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。