

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2019年4月29日-4月30日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周二（4月30日）报6.7286，较上周升值约0.03%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周升值约0.02%，本周最高6.7282、最低6.7422，收于6.7366，波幅为0.21%。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6.7300-6.7500。
- 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29日），市场买卖均衡，掉期点小幅下行；本周二（4月30日），市场交投一般活跃，掉期点小幅上行。截至本周二16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周下行5个点，本周最高178、最低111，收于170，波幅为39.41%。
- 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）较上周下行10个点，本周最高6.7820，最低6.7603，收于6.7713，波幅为0.32%。

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。

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)
即期汇率						
中间价	-	-	6.7286	-21	0	-1346
银行间市场汇价	6.7282	6.7422	6.7366	-15	0	-1292
掉期点						
1 个月期限	0.7	-15.5	-0.3	-0.9	0	0.25
2 个月期限	3.5	1.9	2	-1	0	24
3 个月期限	28.08	5	7.7	-4.3	0	44.7
6 个月期限	57	0	45.2	-6.8	0	159.2
1 年期限	178	111	170	-5	0	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	6.7440	6.7273	6.7336	-7	-1485	-29.70
2 个月期限	6.7465	6.7297	6.736	-19	-1511	-8.00
3 个月期限	6.7490	6.7323	6.7385	-11	-1536	11.30
6 个月期限	6.7580	6.7364	6.7474	-11	-1502	62.80
1 年期限	6.7820	6.7603	6.7713	-10	-1333	177.00

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。