

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年5月6日-5月10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（5月10日）报6.7912，较前周贬值约0.93%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.12%，上周最高6.7588、最低6.8300，收于6.8118，波幅为1.05%。上周境内人民币汇率呈震荡贬值走势。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6.7900-6.8400。
- 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（5月6日），市场买卖力量均衡，流动性较为宽松，各期限掉期点震荡下行；上周二（5月7日），各期限掉期点窄幅区间震荡；上周三（5月8日），市场买卖力量均衡，各期限掉期点略有上行；上周四（5月9日），市场长端购汇客盘较多，各期限掉期点快速上行；上周五，市场走势趋于平稳，各期限掉期点小幅上行。截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行10个点，上周最高170、最低90，收于160，波幅为50%。
- 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 212 个点，上周最高 6.9150、最低 6.7631，收于 6.8834，波幅为 2.21%。

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	-	-	6.7912	626	626	-720
银行间市场汇价	6.8300	6.7588	6.8118	752	752	-540
掉期点						
1 个月期限	5	-9.90	2.50	2.80	2.80	3.05
2 个月期限	5.97	-8.50	4.50	2.50	2.50	26.50
3 个月期限	24.65	-7.50	11	3.30	3.30	48
6 个月期限	46	0	41.50	-3.70	-3.70	155.50
1 年期限	170	90	160	-10	-10	437

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	6.8610	6.7276	6.8387	1105	-434	266.50
2 个月期限	6.8655	6.7298	6.8439	1134	-432	316.50
3 个月期限	6.8705	6.7326	6.8484	1150	-437	355.00
6 个月期限	6.8820	6.7412	6.8595	1173	-381	435.50
1 年期限	6.9150	6.7631	6.8834	1171	-212	556.00

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。