

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年5月13日-5月17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17日）报6.8859，较前周贬值约1.39%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.50%，上周最高6.9188、最低6.8383，收于6.9138，波幅为1.16%。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6.8600-6.9500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅下行。上周一（5月13日），市场预期资金收紧，各期限掉期点冲高回落；上周二（5月14日），远期结汇客盘增多，各期限掉期点继续下行；上周三（5月15日），市场买卖力量较为均衡，各期限掉期点略有下行；上周四（5月16日），市场买卖力量继续维持均衡，各期限掉期点窄幅震荡；上周五（5月17日），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，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行15个点，上周最高190、最低158，收于175，波幅为18.29%。

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1040个点，上周最高6.9931、最低6.8855，收于6.9874，波幅为1.54%。

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	-	-	6.8859	947	1573	227
银行间市场汇价	6.9188	6.8383	6.9138	1020	1772	480
掉期点						
1个月期限	7	-0.1	1.1	-1.4	1.4	1.65
2个月期限	11	3	4.5	0	2.5	26.5
3个月期限	20	0	10.5	-0.5	2.8	47.5
6个月期限	59	0	44.5	3	-0.7	158.5
1年期限	190	158	175	15	5	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	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1个月期限	6.9411	6.8375	6.9370	983	549	230.90
2个月期限	6.9485	6.8427	6.9460	1021	589	317.50
3个月期限	6.9553	6.8475	6.9530	1046	609	381.50
6个月期限	6.9681	6.8590	6.9650	1055	674	467.50
1年期限	6.9931	6.8855	6.9874	1040	828	561.00

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。