

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年5月11日-5月15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15日）报7.0936，较前周贬值约0.21%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.29%，上周最高7.0711、最低7.1036，收于7.0995，波幅为0.46%。上周境内人民币汇率震荡走贬。预计本周人民币汇率或仍将维持震荡格局，交投区间主要集中在7.0800-7.1500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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下行56个点，上周最高680、最低550，收于584，波幅为22.26%。
- 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）较前周上行374个点，上周最高7.2275、最低7.1562，收于7.2176，波幅为0.99%。

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	—	—	7.0936	148	365	1174
银行间市场汇价	7.1036	7.0711	7.0995	203	476	1333
掉期点						
1 个月期限	55	37	42	-2	27	-36
2 个月期限	99	69	84	6	51	-34
3 个月期限	142	40	120	10	68	-45.50
6 个月期限	321.50	235	260	-10	95	-5
1 年期限	680	550	584	-56	114	126

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	7.1390	7.0726	7.1286	384	1660	249
2 个月期限	7.1504	7.0846	7.1406	394	1720	327
3 个月期限	7.1595	7.0931	7.1506	394	1755	391
6 个月期限	7.1835	7.1103	7.1750	379	1845	495
1 年期限	7.2275	7.1562	7.2176	374	1906	597

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。