

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年5月18日-5月22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22日）报7.0939，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0.87%，上周最高7.0930、最低7.1446，收于7.1416，波幅为0.72%。上周境内人民币汇率震荡走贬，主要受市场担忧中美贸易争端升级等因素影响。预计本周人民币汇率仍将延续宽幅波动，交投区间主要集中在7.0900-7.1600。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点有所上行，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12个点，上周最高690、最低336，收于652，波幅为54.29%。
- 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598个点，上周最高7.2592、最低7.1798，收于7.2400，波幅为1.10%。

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	—	—	7.0939	151	368	1177
银行间市场汇价	7.1446	7.0930	7.1416	624	897	1754
掉期点						
1 个月期限	63	44.45	63	19	48	-15
2 个月期限	110	0	108	30	75	-10
3 个月期限	176	54	156	46	104	-9.50
6 个月期限	345	0	305	35	140	40
1 年期限	690	336	652	12	182	194

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	7.1608	7.0898	7.1440	538	1814	-39
2 个月期限	7.1740	7.1013	7.1580	568	1894	56
3 个月期限	7.1850	7.1110	7.1700	588	1949	128
6 个月期限	7.2130	7.1368	7.1960	589	2055	239
1 年期限	7.2592	7.1798	7.2400	598	2130	332

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。