

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年5月25日-5月29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29日）报7.1316，较前周贬值约0.53%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.05%，上周最高7.1260、最低7.1765，收于7.1348，波幅为0.71%。上周境内人民币汇率震荡走贬，主要受市场担忧中美关系趋紧、美国国内示威游行愈演愈烈等因素交织影响。预计本周人民币汇率将维持低位震荡，交投区间主要集中在7.1000-7.2000。
- 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103个点，上周最高790、最低185，收于755，波幅为80.13%。
- 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18个点，上周最高7.2970、最低7.2179，收于7.2382，波幅为1.09%。

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	—	—	7.1316	377	745	1554
银行间市场汇价	7.1765	7.1260	7.1455	39	936	1793
掉期点						
1 个月期限	96	0	87.40	24.40	72.40	9.40
2 个月期限	158	0	151	43	118	33
3 个月期限	224	59	210	54	158	44.50
6 个月期限	420	301	400	95	235	135
1 年期限	790	185	755	103	285	297

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	7.1940	7.1249	7.1317	-123	1691	-225
2 个月期限	7.2089	7.1359	7.1482	-98	1796	-124
3 个月期限	7.2205	7.1474	7.1602	-98	1851	-63
6 个月期限	7.2485	7.1767	7.1896	-64	1991	41
1 年期限	7.2970	7.2179	7.2382	-18	2112	172

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。