

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年5月20日-5月24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6.8993，较前周贬值约0.19%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.13%，上周最高6.8951、最低6.9217，收于6.9050，波幅为0.39%。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继续维持震荡格局，交投区间主要集中在6.8600-6.9500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点窄幅区间震荡。上周一（5月20日），各期限掉期点窄幅区间震荡，尾盘下行较多；上周二（5月21日），各期限掉期点窄幅区间震荡、略有上行；上周三（5月22日），资金面由紧转松，各期限掉期点小幅下行；上周四（5月23日），市场买卖力量均衡，各期限掉期点窄幅震荡；上周五（5月24日），市场走势趋于平稳，掉期点维持震荡。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8.5个点，上周最高172、最低153，收于166.5，波幅为11.41%。
- 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 312 个点，上周最高 6.9897、最低 6.9465，收于 6.9562，波幅为 0.62%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.8993	134	1707	361
银行间市场汇价	6.9217	6.8951	6.9050	-88	1684	392
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	2.9	0	2.2	1.1	2.5	2.75
2 个月期限	6	2.8	5	0.5	3	27
3 个月期限	13	0	11	0.5	3.3	48
6 个月期限	50	0	44	-0.5	-1.2	158
1 年期限	172	153	166.5	-8.5	-3.5	443.5

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	6.9367	6.8940	6.9012	-358	191	-40.20
2 个月期限	6.9452	6.9043	6.9112	-348	241	57.00
3 个月期限	6.9522	6.9114	6.9184	-346	263	123.00
6 个月期限	6.9647	6.9225	6.9317	-333	341	223.00
1 年期限	6.9897	6.9465	6.9562	-312	516	345.50

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。