

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年5月27日-5月31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31日）报6.8992，与前周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.04%，上周最高6.8854、最低6.9181，收于6.9020，波幅为0.47%。上周境内人民币汇率呈震荡走势。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：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行。上周一（5月27日），银行间市场流动性较为紧张，各期限掉期点快速上行；上周二（5月28日），买盘力量继续推动掉期点上行；上周三（5月29日），市场资金面由紧转松，掉期点小幅下行；上周四（5月30日），市场买盘卖盘力量均衡，掉期点小幅上行；上周五，掉期点继续上行。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111.5个点，上周最高288、最低90，收于278，波幅为71.22%。
- 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）较前周上行 262 个点，上周最高 6.9945、最低 6.9303，收于 6.9824，波幅为 0.92%。

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	-	-	6.8992	-1	1706	360
银行间市场汇价	6.9181	6.8854	6.9020	-30	1654	362
掉期点						
1 个月期限	7.91	1	2	-0.2	2.3	2.55
2 个月期限	13	6.5	8	3	6	30
3 个月期限	29	0	18.5	7.5	10.8	55.5
6 个月期限	82	0	68	24	22.8	182
1 年期限	288	90	278	111.5	108	555

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	6.9260	6.8821	6.9129	117	308	107.00
2 个月期限	6.9359	6.8916	6.9229	117	358	201.00
3 个月期限	6.9450	6.8975	6.9334	150	413	295.50
6 个月期限	6.9632	6.9071	6.9505	188	529	417.00
1 年期限	6.9945	6.9303	6.9824	262	778	526.00

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。