

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2019年6月3日-6月6日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周四（6月6日）报6.8945，较前周升值约0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.20%，上周最高6.8975、最低6.9177，收于6.9161，波幅为0.29%。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：市场交投一般活跃，各期限掉期点区间震荡。上周一（6月3日），市场预期资金面有所收紧，掉期点冲高至全周高点370后所有回落；上周二（6月4日），紧张情绪有所缓解，掉期点小幅下行；上周三（6月5日），市场买卖盘力量均衡，掉期点略有下行；上周四，市场交投力量均衡，掉期点窄幅震荡。截至上周四16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行60个点，上周最高370、最低275，收于338，波幅为28.11%。
- 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84个点，上周最高

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。

6.9900、最低 6.9465，收于 6.9740，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)
即期汇率						
中间价	-	-	6.8945	-47	-47	313
银行间市场汇价	6.9177	6.8975	6.9161	141	141	503
掉期点						
1 个月期限	4	-6	-2	-4	-4	-1.45
2 个月期限	12	-3	2	-6	-6	24
3 个月期限	33	0	9.5	-9	-9	46.5
6 个月期限	120	0	67.5	-0.5	-0.5	181.5
1 年期限	370	275	338	60	60	615

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	6.9210	6.8820	6.9018	-111	197	-141.00
2 个月期限	6.9315	6.8910	6.9115	-114	244	-48.00
3 个月期限	6.9405	6.9000	6.9210	-124	289	39.50
6 个月期限	6.9590	6.9040	6.9380	-125	404	151.50
1 年期限	6.9900	6.9465	6.9740	-84	694	241.00

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。