

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年4月27日-4月30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（4月30日）报 7.0571，较前周升值约 0.33%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.44%，上周最高 7.0470、最低 7.0906，收于 7.0519，波幅为 0.62%。上周境内人民币汇率震荡走强。预计本周人民币汇率或仍将维持震荡格局，交投区间主要集中在 7.0500-7.1300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅震荡，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 30 个点，上周最高 485、最低 425，收于 470，波幅为 12.77%。
- 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 515 个点，上周最高 7.2220、最低 7.1042，收于 7.2055，波幅为 1.63%。

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	—	—	7.0571	-232	0	809
银行间市场汇价	7.0906	7.0470	7.0519	-310	0	857
掉期点						
1 个月期限	25	14	15	-4	0	-63
2 个月期限	50	20	33	-1.50	0	-85
3 个月期限	74	38	52	6	0	-113.50
6 个月期限	175	125	165	30	0	-100
1 年期限	485	425	470	30	0	12

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	7.1420	7.0382	7.1309	442	1683	775
2 个月期限	7.1495	7.0432	7.1424	474	1738	872
3 个月期限	7.1557	7.0492	7.1517	501	1766	946
6 个月期限	7.1830	7.0642	7.1649	456	1744	965
1 年期限	7.2220	7.1042	7.2055	515	1785	1066

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。