

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年5月6日-5月8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8日）报7.0788，较前周贬值约0.31%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.39%，上周最高7.0694、最低7.1087，收于7.0792，波幅为0.56%。上周境内人民币汇率震荡走贬。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7.0800-7.1300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点有所震荡，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170个点，上周最高640、最低470，收于640，波幅为26.56%。
- 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253个点，上周最高7.2280、最低7.1476，收于7.1802，波幅为1.12%。

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	—	—	7.0788	217	217	1026
银行间市场汇价	7.1087	7.0694	7.0792	273	273	1130
掉期点						
1 个月期限	45	0	44	29	29	-34
2 个月期限	78.60	0	78	45	45	-40
3 个月期限	115	0	110	58	58	-55.50
6 个月期限	278	155	270	105	105	5
1 年期限	640	470	640	170	170	182

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	7.1545	7.0588	7.0902	-407	1276	66
2 个月期限	7.1635	7.0755	7.1012	-412	1326	142
3 个月期限	7.1710	7.0835	7.1112	-405	1361	210
6 个月期限	7.1890	7.1055	7.1371	-278	1466	309
1 年期限	7.2280	7.1476	7.1802	-253	1532	370

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。