

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年6月12日-6月16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（6月16日）报6.7995，较前周贬值约0.04%。银行间外汇市场人民币对美元较前周贬值约0.22%，上周最高6.7880、最低6.8172，收于6.8139，波幅为0.43%。人民币上周震荡贬值，交投情况差异明显。上周前三个交易日，人民币汇率区间震荡，全天的波幅均在30个点左右；上周随后两个交易日，受市场供求因素影响，人民币震荡贬值。预计本周人民币汇率将区间震荡，阻力位6.7900，支撑位6.8250。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投较为活跃，全周各期限掉期点震荡下行后反弹，截至上周五16:30，掉期曲线较前周小幅变陡上移。上周前三个交易日，市场等待美联储货币政策会议决议，市场交投比较谨慎，掉期点小幅下挫；上周随后两个交易日，随着美联储货币政策会议释放偏鹰派加息信号，掉期点回升，次日期掉期点收盘成交在4.9位置，1年期掉期点稳定在1270上方，掉期市场重回高位震荡格局。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较前周下跌10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。

1305、最低 1227，收于 1270，波幅为 6.14%。

- 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）较前周上涨 345 个点，上周最高 7.0115、最低 6.9493，收于 6.9895，波幅为 0.89%。

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	—	—	6.7995	24	-638	-1375
银行间市场汇价	6.8172	6.7880	6.8139	151	-71	-1354
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	170	144	155	-8	50	67
2 个月期限	320	145	300	-14	87	120
3 个月期限	445	275	420	-15	95	170
6 个月期限	770	690	735	-4	165	314
1 年期限	1305	1227	1270	-10	270	670

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	6.8380	6.7937	6.8210	155	-2125	-84
2 个月期限	6.8600	6.8090	6.8380	180	-2470	-59
3 个月期限	6.8765	6.8195	6.8550	205	-2615	-9
6 个月期限	6.9220	6.8648	6.9005	235	-2950	131
1 年期限	7.0115	6.9493	6.9895	345	-3295	486

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。