

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年7月17日-7月21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（7月17日）报 6.7415，较前周升值约 0.53%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.24%，上周最高 6.7464、最低 6.7762，收于 6.7681，波幅为 0.44%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受美元指数快速下行、欧元对美元大幅上涨影响。银行间外汇市场供求基本均衡。预计本周人民币汇率双边波动，阻力位 6.7400，支撑位 6.8000。
- 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。截至上周五 16:30，掉期曲线较上周小幅变平下移。短期限方面，前半周资金面偏紧但受到长端卖盘压制，短期限掉期点上行幅度有限，上周四（7月20日）资金面好转后在日均 3.0 位置持稳。中长期方面，主要受到银行间卖盘影响，长端掉期点被压制在低位，特别在后半周 1 年期掉期点集中在 900 下方来回交投，缺乏上行动力。截至上周五 16:30，1 年期美元对人民币掉期点较前周下跌 65 个点，上周最高 950、最低 500，收于 880，波幅为 51.14%。

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。

- 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）较前周下跌178个点，上周最高6.9225、最低6.8695，收于6.8850，波幅为0.77%。

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	—	—	6.7415	-359	-329	-1955
银行间市场汇价	6.7762	6.7464	6.7681	-161	-115	-1812
<b>掉期点</b>						
1个月期限	150	91	102	-4	-27	14
2个月期限	220	165	200	-7	-50	20
3个月期限	382	228	295	-16	-95	45
6个月期限	582	388	520	-25	-145	99
1年期限	950	500	880	-65	-265	280

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	6.7900	6.7485	6.7590	-150	-2745	-193
2个月期限	6.8050	6.7601	6.7745	-140	-3105	-136
3个月期限	6.8190	6.7595	6.7880	-145	-3285	-96
6个月期限	6.8570	6.8050	6.8240	-175	-3715	39
1年期限	6.9225	6.8695	6.8850	-178	-4340	289

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。