工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2017 年 7 月 31 日-8 月 4 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（8 月 4 日）报 6.7132，较前周升值约 0.36%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.37%，上周最高 6.7154、最低 6.7352，收于 6.7179，波幅为 0.29%。上周受美元指数走势疲弱、境内银行间外汇市场整体偏美元卖盘的影响，境内人民币呈现震荡走升的态势。预测本周人民币汇率可能会小幅升值，并在 6.7000-6.7300 区间内窄幅波动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投较为活跃，各期限掉期点震荡上行。截至上周五下午 16:30，掉期曲线较前周变陡上移，1 年期限美元兑人民币掉期点收于 1015 的位置，上周最高 1070、最低 438，波幅为 62.27%。
- 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 157 个点，上周最高 6.8775、最低 6.8425，收于 6.8765，波幅为 0.51%。

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	—	—	6.7132	-241	-151	-2238
银行间市场汇价	6.7352	6.7154	6.7179	-250	-111	-2314
掉期点						
1 个月期限	141	100.8	107	10	-17	19
2 个月期限	265	0	223	-2	-17	43
3 个月期限	351	265	315	25	-1	65
6 个月期限	625	527	582	55	29	161
1 年期限	1070	438	1015	135	85	415

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	6.7465	6.7185	6.7370	22	-2965	84
2 个月期限	6.7620	6.7310	6.7500	5	-3350	98
3 个月期限	6.7710	6.7325	6.7630	-10	-3535	136
6 个月期限	6.8055	6.7770	6.8010	82	-3945	249
1 年期限	6.8775	6.8425	6.8765	157	-4425	571

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。