

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年8月7日-8月11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11日）报6.6642，较前周升值约0.73%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.76%，上周最高6.6485、最低6.7287，收于6.6668，波幅为1.20%。上周前四个交易日，人民币大幅升值约1.11%，连续突破6.70、6.69、6.68等多个整数关口，最高升值至6.6485，创近十个月以来新高，与美元指数走势形成背离。预计本周人民币汇率可能会小幅上涨，并在6.65-6.70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年期限美元对人民币掉期点收于1129的位置，上周最高1148、最低967，波幅为16.03%。
- 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715个点，上周最高6.8755，最低6.7918，收于6.8050，波幅为1.23%。

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	—	—	6.6642	-490	-641	-2728
银行间市场汇价	6.7287	6.6485	6.6668	-511	-622	-2825
掉期点						
1 个月期限	123.28	100	110	3	-13	22
2 个月期限	246	200	223	0	-57	43
3 个月期限	350	280	330	15	15	80
6 个月期限	675	548	645	63	92	224
1 年期限	1148	967	1129	114	200	529

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	6.7385	6.6594	6.6730	-640	-3605	-48
2 个月期限	6.7515	6.672	6.6860	-640	-3990	-31
3 个月期限	6.764	6.6845	6.6985	-645	-4180	-13
6 个月期限	6.8015	6.7178	6.7370	-640	-4585	57
1 年期限	6.8755	6.7918	6.8050	-715	-5140	253

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。