

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年9月25日-9月29日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价前周五（9月29日）报6.6369，较9月22日贬值约0.77%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月22日贬值约0.83%，前周最高6.5940、最低6.6842，收于6.6470，波幅为1.36%。
- 交投较为活跃，各期限掉期点震荡上行。截至前周五下午16:30，掉期曲线较9月22日变陡上移。短期限方面，前周掉期点日均主要集中在3.5位置交投；中长期方面，掉期点有所上行，其中一年期掉期点集中围绕在1000-1070点位置震荡交投。截止前周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点上涨10个点，前周最高1085、最低969，收于1012，波幅为11.46%。
- 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9月22日上涨641个点，前周最高6.8355、最低6.7124，收于6.7871，波幅为1.81%。

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	-	-	6.6369	508	0	-3001
银行间市场汇价	6.6842	6.5940	6.6470	548	0	-3023
掉期点						
1 个月期限	173	54.50	103	4	0	15
2 个月期限	281	189	205	7	0	13
3 个月期限	360	279	295	20	0	45
6 个月期限	620	509	550	10	0	129
1 年期限	1085	969	1012	10	0	412

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	6.6900	6.5825	6.6561	661	-3774	-12
2 个月期限	6.7055	6.6000	6.6699	659	-4151	24
3 个月期限	6.7200	6.6125	6.6829	674	-4336	64
6 个月期限	6.7605	6.6470	6.7211	681	-4744	191
1 年期限	6.8355	6.7124	6.7871	641	-5319	389

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。