

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年10月9日-10月13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（10月13日）报6.5866，较前周升值约0.76%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.91%，上周最高6.5732、最低6.6566，收于6.5868，波幅为1.27%。上周人民币汇率呈现震荡上涨走势，境内人民币自6.6500上方逐渐升值至6.5800附近，上涨约700个点。由于上周美元指数连续下跌，人民币中间价高开高走，引发离岸与在岸人民币汇率同时出现大幅上涨的局面。预计本周人民币汇率将维持区间震荡、整体稳定态势，波动区间主要位于6.5500-6.6500。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投较为谨慎，各期限端掉期点震荡下行。截至周五下午16:30，掉期曲线较上周变平下移。短期限方面，上周掉期点日均重回4下方交投；中长期方面，掉期点在前周收盘位置基础上开始下行，其中1年期掉期点集中围绕在930-1050点位置震荡交投。截止上周五下午16:30，1年期限美元对人民币掉期点下跌37个点，上周最高1070、最低913，收于975，波幅为16.10%。

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）较上周下跌904个点，上周最高6.8105、最低6.7040，收于6.7085，波幅为1.59%。

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			6.5866	-503	-503	-3504
银行间市场汇价	6.6566	6.5732	6.5868	-602	-602	-3625
掉期点						
1个月期限	302	100	115	12	12	27
2个月期限	260	191	215	10	10	13
3个月期限	392	292	316	21	21	66
6个月期限	630	498	560	10	10	139
1年期限	1070	913	975	-37	-37	375

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	6.6690	6.5715	6.5797	-799	-4538	-186
2个月期限	6.6835	6.5845	6.5960	-780	-4890	-123
3个月期限	6.7105	6.5985	6.6095	-779	-5070	-89
6个月期限	6.7375	6.6345	6.6450	-811	-5505	22
1年期限	6.8105	6.7040	6.7085	-904	-6105	242

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。