

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年10月23日-10月27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27日）报6.6473，较前周贬值约0.58%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.50%，上周最高6.6274、最低6.6645，收于6.6528，波幅为0.56%。上周人民币汇率呈现区间震荡整理态势，境内人民币主要集中在6.6200-6.6600区间波动，约有400余个点。预测本周人民币汇率将维持宽幅震荡、整体走软态势，波动区间主要位于6.6000-6.6700。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投较为活跃，各期限端掉期点窄幅震荡交投。截至上周五下午16:30，掉期曲线较上周末变平下移。短期限方面，掉期点价格从上周高位回落，日均重回3.6下方交投；中长期方面，掉期点价格较上周小幅下行，其中1年期掉期点价格集中围绕在950-1000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16个点，上周最高1007、最低405，收于969，波幅为62.13%。
- 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）较上周上涨230个点，上周最

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。

高 6.8190、最低 6.7702，收于 6.7625，波幅为 0.72%。

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	-	-	6.6473	381	104	-2897
银行间市场汇价	6.6645	6.6274	6.6528	328	58	-2965
掉期点						
1 个月期限	127.5	96	116	0	13	28
2 个月期限	230	176	213	-12	8	13
3 个月期限	342	295	327	3	32	77
6 个月期限	600	241	564	-10	14	143
1 年期限	1007	405	969	-16	-43	369

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	6.6740	6.6300	6.6580	275	-3755	-64
2 个月期限	6.6905	6.6465	6.6745	275	-4105	4
3 个月期限	6.7070	6.6570	6.6915	310	-4250	60
6 个月期限	6.7445	6.6980	6.7300	320	-4655	208
1 年期限	6.8190	6.7702	6.7925	230	-5265	428

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。