

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年10月30日-11月3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（11月3日）报6.6072，较前周升值约0.60%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.35%，上周最高6.5827、最低6.6505，收于6.6375，波幅为1.02%。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6.5800-6.6400区间波动，约有600余个点。预测本周人民币汇率将维持宽幅震荡态势，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，掉期曲线较上周末小幅变陡上移。短期限方面，掉期点从上周初高位开始回撤，长端掉期主要在950-980点位置窄幅震荡交投。截止上周五下午16:30，1年期限美元对人民币掉期点上涨3个点，上周最高1020、最低943，波幅为8.16%。
- 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55个点，上周最高6.8065、最低6.7325，收于6.787，波幅为1.09%。

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	-	-	6.6072	-401	-325	-3298
银行间市场汇价	6.6505	6.5827	6.6295	-233	23	-3198
掉期点						
1 个月期限	130	91	113.5	-3	-6.5	18.5
2 个月期限	238	210	236	23	15	56
3 个月期限	350	301	334	8	11	74
6 个月期限	659	531	580	18	8	165
1 年期限	1020	943	972	3	-3	427

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	6.6635	6.595	6.6455	-125	-3880	-33.5
2 个月期限	6.6796	6.6105	6.6625	-120	-4225	14
3 个月期限	6.695	6.6275	6.6785	-130	-4380	76
6 个月期限	6.735	6.668	6.716	-140	-4795	205
1 年期限	6.8065	6.7325	6.787	-55	-5320	523

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。