

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年11月6日-11月10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10日）报6.6282，较前周贬值约0.32%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.16%，上周最高6.6212、最低6.6460，收于6.6400，波幅为0.37%。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6.6200-6.6450区间波动，约有250余个点。预计本周人民币汇率双向波动，波动区间主要位于6.6200-6.6600。
- 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平下移。短期限方面，掉期点从上周初低位开始反弹。中长期期限方面，掉期点主要集中在940-980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下跌7个点，上周最高1004、最低945，收于964，波幅为6.11%。
- 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222个点，上周最高6.8107、最低6.7635，收于6.8092，波幅为0.69%。

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	-	-	6.6282	210	-115	-3088
银行间市场汇价	6.6460	6.6212	6.6400	105	128	-3093
掉期点						
1 个月期限	114.68	100.13	109	-4.5	-11	21
2 个月期限	245	210	236	0	15	13
3 个月期限	350	296	337	3	14	87
6 个月期限	608	515	557	-23	-15	136
1 年期限	1004	945	965	-7	-10	365

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	6.6704	6.6285	6.6704	249	-3631	195
2 个月期限	6.6885	6.6450	6.6885	260	-3965	249
3 个月期限	6.7036	6.6615	6.7036	251	-4129	299
6 个月期限	6.7414	6.7005	6.7414	254	-4541	457
1 年期限	6.8107	6.7635	6.8092	222	-5098	727

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。