

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年11月13日-11月17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17日）报6.6277，较前周升值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.07%，上周最高6.6105、最低6.6525，收于6.6353，波幅为0.63%。上周人民币汇率双向波动，略有升值，境内人民币主要集中在6.6200-6.6450区间震荡，约有250余个点。预计本周人民币汇率双向波动、略有升值，波动区间主要位于6.6000-6.6450。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投一般活跃，各期限端掉期点窄幅震荡交投。截至上周五16:30，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下行。中长期方面，掉期点主要在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上涨13个点，上周最高985、最低939，收于978，波幅为4.70%。
- 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302个点，上周最高6.8140、最低6.7650，收于6.7790，波幅为0.72%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.6277	-5	-120	-3093
银行间市场汇价	6.6525	6.6105	6.6353	-47	81	-3140
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	116.19	106	108	-1	-12	20
2 个月期限	244.90	222	223	-13	2	13
3 个月期限	390	350	360	23	37	110
6 个月期限	611	206	580	23	8	159
1 年期限	985	939	978	13	3	378

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	6.6730	6.6290	6.6430	-274	-3905	-31
2 个月期限	6.6915	6.6450	6.6600	-285	-4250	24
3 个月期限	6.7085	6.6635	6.6760	-276	-4405	47
6 个月期限	6.7455	6.6980	6.7120	-294	-4835	187
1 年期限	6.8140	6.7650	6.7790	-302	-5400	459

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。