工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2017 年 11 月 20 日-11 月 24 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 24 日）报 6.5810，较前周升值约 0.70%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.48%，上周最高 6.5730、最低 6.6421，收于 6.6037，波幅为 1.05%。上周境内人民币先升后贬、V 形逆转，主要集中在 6.5700-6.6400 区间震荡，约有 700 余个点。预计本周人民币呈先贬后升走势，波动区间主要位于 6.5900-6.6400。
- 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上行。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，周内日均掉期点主要保持 3.0 下方成交。中长期限方面，掉期点主要在 990-1060 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 47 个点，上周最高 1062、最低 954，收于 1025，波幅为 10.54%。
- 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 452 个点，上周最高 6.8020、最低 6.7185，收于 6.7338，波幅为 1.24%。

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	-	-	6.5810	-467	-587	-3560
银行间市场汇价	6.6421	6.5730	6.6037	-316	-235	-3456
掉期点						
1 个月期限	130	107.3	111	3	-9	23
2 个月期限	249	224	238	15	17	13
3 个月期限	406	336	365	5	42	115
6 个月期限	639	240	606	26	34	185
1 年期限	1062	954	1025	47	50	425

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	6.6625	6.5825	6.5990	-440	-4345	-158
2 个月期限	6.6800	6.5990	6.6210	-390	-4640	-65
3 个月期限	6.6955	6.6130	6.6365	-395	-4800	-37
6 个月期限	6.7340	6.6530	6.6668	-452	-5287	25
1 年期限	6.8020	6.7185	6.7338	-452	-5852	276

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。