

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年11月27日-12月1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（12月1日）报6.6067，较前周贬值约0.39%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.04%，上周最高6.5910、最低6.6210，收于6.6065，波幅为0.45%。预计本周人民币汇率主要波动区间为6.5900-6.6150。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限端掉期点震荡交投。截至上周五16:30，掉期曲线较前周小幅变陡上移。短期限方面，日均次日期限掉期点主要保持3.0下方交投；中长期方面，1年期掉期点主要在1010-1060区间内窄幅震荡交投。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点收于1035，上周最高1066、最低433，波幅为61.16%。
- 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）较前周上涨137个点，上周最高6.7855，最低6.7315，收于6.7475，波幅为0.80%。

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	-	-	6.6067	257	33	-3303
银行间市场汇价	6.6210	6.5910	6.6065	28	-42	-3428
掉期点						
1 个月期限	126	105	112	1	-3	24
2 个月期限	250	226	226.5	-11.5	-7.5	13
3 个月期限	380	246	353	-12	-9	103
6 个月期限	636	245	603	-3	-6	182
1 年期限	1066	433	1035	10	-5	435

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	6.6370	6.6000	6.6035	45	-4300	-142
2 个月期限	6.6565	6.6170	6.6230	20	-4620	-61.5
3 个月期限	6.6730	6.6270	6.6380	15	-4785	-38
6 个月期限	6.7145	6.6668	6.6790	122	-5165	122
1 年期限	6.7855	6.7315	6.7475	137	-5715	375

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。