工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2017 年 12 月 4 日-12 月 8 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 8 日）报 6.6218，较前周贬值约 0.23%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.17%，上周最高 6.6085、最低 6.6277，收于 6.6175，波幅为 0.29%。预计本周人民币汇率仍将维持震荡格局，主要波动区间为 6.6000-6.6500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限端掉期点震荡上行。截至上周五 16:30，掉期曲线较上周小幅变陡上移。短期限方面，1 周内日均次日期限掉期点主要保持 3.0 下方成交。中长期限方面，1 年期掉期点主要在 1050-1100 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 1060，上周最高 1110、最低 1023，波幅为 8.21%。
- 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 285 个点，上周最高 6.7890，最低 6.7510，收于 6.7760，波幅为 0.56%。

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	-	-	6.6218	151	184	-3152
银行间市场汇价	6.6277	6.6085	6.6175	110	68	-3318
掉期点						
1 个月期限	140	90	117	5	2	29
2 个月期限	280	222	232	5.5	-2	13
3 个月期限	383	324	348	-5	-14	98
6 个月期限	645	588	601	-2	-8	180
1 年期限	1110	1023	1060	25	20	460

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	6.6365	6.6050	6.6300	265	-4035	8
2 个月期限	6.6570	6.6230	6.6480	250	-4370	73
3 个月期限	6.6750	6.6410	6.6645	265	-4520	122
6 个月期限	6.7180	6.6825	6.7060	270	-4895	284
1 年期限	6.7890	6.7510	6.7760	285	-5430	525

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。