

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年12月11日-12月15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15日）报6.6113，较前周升值约0.16%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.14%，上周最高6.6040、最低6.6298，收于6.6084，波幅为0.39%。上周人民币汇率呈现窄幅震荡升值的格局，全周处于6.6050-6.6300的区间内宽幅震荡。预计本周人民币汇率将继续维持震荡格局，主要波动区间为6.5800-6.6300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限端掉期点冲高回落。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在3.0左右成交。中长期方面，1年期掉期点主要在1070-1110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1066，上周最高1134、最低1037，波幅为9.10%。
- 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）较前周下跌192个点，上周最高6.7515，最低6.7905，收于6.7568，波幅为0.58%。

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	-	-	6.6113	-105	79	-3257
银行间市场汇价	6.6298	6.6040	6.6084	-91	-23	-3409
掉期点						
1 个月期限	136.5	45	121	3.5	5.5	32.5
2 个月期限	303	229	272	39.8	37.8	13
3 个月期限	387	303	353	5	-9	103
6 个月期限	667	585	613	12	4	192
1 年期限	1134	1037	1066	6	26	466

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	6.6410	6.6055	6.6148	-152	-4187	-56.5
2 个月期限	6.6640	6.6235	6.6350	-130	-4500	-5.8
3 个月期限	6.6780	6.6340	6.6520	-125	-4645	83
6 个月期限	6.7205	6.6830	6.6883	-177	-5072	186
1 年期限	6.7905	6.7515	6.7568	-192	-5622	418

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。