

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年12月18日-12月22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22日）报6.5821，较前周升值约0.44%。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6.5538、最低6.6182，收于6.5765，波幅为0.98%。上周人民币汇率呈现震荡升值走势，从6.6150一度升破6.5600整数关口。预计随着圣诞和新年假期来临，国际市场整体交投较为平静，本周人民币汇率仍将维持震荡格局，主要波动区间为6.5500-6.6000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限端掉期点高位回落。截至上周五16:30，掉期曲线较前周小幅变平下移。短期限方面，次日期限掉期点主要保持在2.5左右成交。中长期期限方面，1年期掉期点主要在1020-1060区间窄幅震荡交投。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点收于1029，上周最高1097、最低1027，波幅为6.80%。
- 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575个点，上周最高6.7905，最低6.7515，收于6.6993，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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.5821	-292	-213	-3549
银行间市场汇价	6.6182	6.5538	6.5765	-319	-342	-3728
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	139	101.48	120	-0.5	5	32
2 个月期限	285	207.51	253	-18.8	19	13
3 个月期限	371	299	343	-10	-19	93
6 个月期限	647	580	594	-19	-15	173
1 年期限	1097	1027	1029	-37	-11	429

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	6.5748	-400	-4587	-137
2 个月期限	6.6640	6.6235	6.5895	-455	-4955	-123
3 个月期限	6.6780	6.6340	6.6045	-475	-5120	-63
6 个月期限	6.7205	6.6830	6.6408	-475	-5547	49
1 年期限	6.7905	6.7515	6.6993	-575	-6197	199

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。