

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2017年10月16日-10月20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（10月16日）报6.6092，较前周贬值约0.34%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.50%，上周最高6.5729、最低6.6390，收于6.6200，波幅为1.00%。上周人民币汇率呈现震荡走软态势，境内人民币自6.5900逐渐贬值到6.6300附近，下跌空间约有400余个点。预计本周人民币汇率将维持区间震荡、整体稳定态势，波动区间主要位于6.5000-6.6500。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投较为活跃，各期限端掉期点窄幅震荡交投。截至上周五下午16:30，掉期曲线基本维持上周末形态。短期限方面，掉期点价格从上周高位回落，日均重回3.6下方交投；中长期方面，掉期点价格基本与前周收盘位置持平，其中1年期掉期点价格集中围绕在960-1010点位置震荡交投。截止上周五下午16:30，1年期限美元对人民币掉期点上涨10个点，上周最高1038、最低929，收于985，波幅为11.07%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较上周上涨 610 个点，上周最高 6.7960、最低 6.7100，收于 6.7695，波幅为 1.27%。

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	-	-	6.6092	226	-277	-3278
银行间市场汇价	6.6390	6.5729	6.6200	332	-270	-3293
掉期点						
1 个月期限	131	100.79	116	1	13	28
2 个月期限	230	200	225	10	20	13
3 个月期限	351	295	324	8	29	74
6 个月期限	606	330	574	14	24	153
1 年期限	1038	929	985	10	-27	385

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	6.6520	6.5810	6.6305	508	-4030	-11
2 个月期限	6.6690	6.5960	6.6470	510	-4380	45
3 个月期限	6.6835	6.6095	6.6605	510	-4560	81
6 个月期限	6.7220	6.6460	6.6980	530	-4975	206
1 年期限	6.7960	6.7100	6.7695	610	-5495	510

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。