

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年8月27日-8月31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（8月31日）报6.8246，较前周升值约0.68%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.70%，上周最高6.8025、最低6.8480，收于6.8310，波幅为0.67%。上周境内人民币汇率呈现小幅震荡升值走势。预计本周人民币汇率可能仍然维持宽幅震荡格局，交投区间主要集中在6.8000-6.9000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，整体呈小幅震荡上行走势。中长期限方面，前四个交易日市场整体小幅走贬，1年期掉期点从-165的位置逐步走贬至上周四（8月30日）-215的位置，但是上周五有所回升，从-200的位置上行至-172的位置收盘。本周1年期中美国债利差围绕40点区间震荡，中美利差缩窄对掉期点带来一定下行压力。银行间市场资金面松紧适度，市场资金供求基本都能得到满足，全周资金价格基本持平。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较前周上涨28个点，上周最高-120、最低-255，收于-172，波幅

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。

为 78.49%。

- 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 338 个点，上周最高 6.9335、最低 6.8355，收于 6.8969，波幅为 1.42%。

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	—	—	6.8246	-464	81	2904
银行间市场汇价	6.8480	6.8025	6.8310	120	129	3190
掉期点						
1 个月期限	2	-15	1	17	2	-115
2 个月期限	-8	-30	-8	25	-3	-248
3 个月期限	-20	-50	-22	29	-7	-349
6 个月期限	-60	-107	-70	34	-45	-645
1 年期限	-120	-255	-172	28	-117	-1170

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	6.8755	6.7840	6.8424	323	3213	113
2 个月期限	6.8815	6.7897	6.8484	318	3126	182
3 个月期限	6.8870	6.7954	6.8544	313	3062	256
6 个月期限	6.9030	6.8108	6.8694	333	2865	454
1 年期限	6.9335	6.8355	6.8969	338	2474	831

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。