

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年1月29日-2月2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（2月2日）报6.2885，较前周升值约0.87%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.68%，上周最高6.2681、最低6.3460，收于6.2798，波幅为1.24%。上周受美元指数走势疲弱、境内银行间外汇市场整体偏结汇等因素影响，境内人民币呈现震荡走升的态势。预计本周人民币汇率存在小幅升值动力，主要波动区间为6.2500-6.3500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点从上周初高位逐步下行。截至上周五下午16:30，掉期曲线较上周变平下移。短期限方面，次日期限掉期点价格在上周五跌破2.0。中长期方面，1年期掉期点在上周初1180高位附近逐渐单边下行至周末的1110附近。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较前周下跌20个点，上周最高1201、最低1049，收于1120，波幅为13.57%。
- 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286个点，上周最

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。

高 6.4810，最低 6.4010，收于 6.4304，波幅为 1.24%。

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	-	-	6.2885	-551	-454	-2457
银行间市场汇价	6.3460	6.2681	6.2798	-429	-122	-2322
掉期点						
1 个月期限	145.50	105	122	-10.75	-8	6
2 个月期限	275	118	246	-1	-1	13
3 个月期限	401	314	331	-19	-16	4
6 个月期限	691	585	610	-35	-8	35
1 年期限	1201	1049	1120	-20	-18	122

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	6.3625	6.2885	6.3209	-231	-2002	289
2 个月期限	6.3780	6.3035	6.3349	-226	-2009	305
3 个月期限	6.3905	6.3145	6.3520	-180	-1962	391
6 个月期限	6.4240	6.3455	6.3754	-271	-2075	346
1 年期限	6.4810	6.4010	6.4304	-286	-2191	386

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。