

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年2月5日-2月9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9日）报6.3194，较前周贬值约0.49%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.33%，上周最高6.2519、最低6.3550，收于6.3004，波幅为1.64%。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。受美元指数低位反弹、境内部分投资者美元空头回补等因素影响，境内人民币呈现高位回落、宽幅震荡态势。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：市场交投比较清淡，各期限掉期点在上周初低位震荡交投后逐步上行。截至上周五下午16:30，掉期曲线较上周变陡上移。中长期方面，1年期掉期点在上周低位基础上有所上行，盘中逼近1200点整数关口，但在上周五尾盘回撤至1150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上涨25个点，上周最高1185、最低1087，收于1145，波幅为8.56%。

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。

- 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100个点，上周最高6.5080，最低6.3800，收于6.4404，波幅为1.99%。

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	-	-	6.3194	309	-145	-2148
银行间市场汇价	6.3550	6.2519	6.3004	206	84	-2116
掉期点						
1个月期限	132	110.66	125	3	-5	9
2个月期限	253	234.70	247.50	1.50	0.50	13
3个月期限	360	320	351	20	4	24
6个月期限	665	595	638	28	20	63
1年期限	1185	1087	1145	25	7	147

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	6.3900	6.2670	6.3280	71	-1931	151
2个月期限	6.4060	6.2810	6.3460	111	-1898	208.5
3个月期限	6.4185	6.2945	6.3600	80	-1882	245
6个月期限	6.4525	6.3255	6.3935	181	-1894	293
1年期限	6.5080	6.3800	6.4404	100	-2091	255

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。