

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年2月26日-3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（3月2日）报6.3334，较前周升值约0.23%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.15%，上周最高6.2936、最低6.3622，收于6.3472，波幅为1.08%。受上周美元指数震荡上行、境内交易商买入美元的影响，境内人民币汇率呈现震荡走贬格局。预计本周人民币汇率走势企稳，交投区间在6.3200-6.3700。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，虽短端掉期点明显上扬，但长端掉期点仍被卖盘压制。截至上周五16:30，掉期曲线较前周变动不大。短期限方面，日均次日掉期点从上周初2.8左右上行至日均3.3上方成交。中长期方面，1年期掉期点从周初1030一线开始小幅反弹，但在1050附近受卖盘压制。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1个点，上周最高1091、最低1016，收于1043，波幅为7.19%。
- 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46个点，上周最高

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。

6.4975，最低 6.4104，收于 6.4575，波幅为 1.35%。

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	—	—	6.3334	-148	40	-2008
银行间市场汇价	6.2936	6.3622	6.3472	0	139	-1690
掉期点						
1 个月期限	124.45	41.3	114.49	16.39	7.49	-1.51
2 个月期限	221	200	220	11	7.5	-20
3 个月期限	330	291	316	8	-5	-11
6 个月期限	631	554	584	11	-2	9
1 年期限	1091	459	1043	1	-2	53

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	6.3820	6.2985	6.3408	49	-1803	-178.49
2 个月期限	6.3955	6.3115	6.3548	34	-1810	-144
3 个月期限	6.4085	6.3245	6.3677	-3	-1805	-111
6 个月期限	6.4405	6.3550	6.4006	52	-1823	-50
1 年期限	6.4975	6.4104	6.4575	46	-1920	60

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。