

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年4月9日-4月13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（4月13日）报6.2898，较前周升值约0.04%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.28%，上周最高6.2655、最低6.3186，收于6.2825，波幅为0.85%。上周受美元指数小幅走跌、市场对中美贸易冲突担忧有所缓解等因素影响，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维持在6.2700-6.3400区间内震荡波动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行。截至上周五16:30，掉期曲线较前周小幅变陡。短期限方面，掉期点价格保持在日均1.4-1.8成交。中长期方面，1年期掉期点整体震荡上行，上周一（4月9日）曾向下突破500关口，为2017年初以来最低水位，随后开始上行趋势，一直上行至700一线并遇到一定阻力位，最终收于650。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65个点，上周最高690、最低491，收于650，波幅为30.62%。
- 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）较前周下跌 466 个点，上周最高 6.4120、最低 6.3489，收于 6.3614，波幅为 0.99%。

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	—	—	6.2898	-28	17	-2444
银行间市场汇价	6.3186	6.2655	6.2825	-174	92	-2295
掉期点						
1 个月期限	60	46	58	5	-3	-58
2 个月期限	142	95	113	2	-12	-127
3 个月期限	200	140	172	7	-17	-155
6 个月期限	365	256	336	27	-31	-239
1 年期	690	491	650	65	-30	-348

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	6.3330	6.2722	6.2799	-359	-2412	-84
2 个月期限	6.3420	6.2817	6.2909	-486	-2449	-29
3 个月期限	6.3225	6.2925	6.3032	-458	-2450	35
6 个月期限	6.3700	6.3112	6.3214	-329	-2615	53
1 年期	6.4120	6.3489	6.3614	-466	-2881	139

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。