

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年4月16日-4月20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20日）报6.2897，较前周变动不大。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.12%，上周最高6.2600、最低6.2979，收于6.2898，波幅为0.60%。上周境内人民币汇率呈现宽幅震荡走势。预计本周人民币汇率可能维持在6.2800-6.3500区间内震荡波动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，短端掉期点一路上行，长端掉期点高位震荡后快速下行。截至上周五16:30，掉期曲线较前周显著变平。短期限方面，从上周三（4月18日）开始短端资金持续紧张，掉期点价格最高达到单日10以上。中长期方面，上周初1年期掉期点高位震荡，上周三受降准消息影响快速下行至580一线获得支撑，最终收于596位置。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54个点，上周最高711、最低320，收于596，波幅为65.60%。
- 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85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。

6.3880、最低 6.3480，收于 6.3699，波幅为 0.63%。

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	—	—	6.2897	-1	16	-2445
银行间市场汇价	6.2979	6.2600	6.2898	73	165	-2222
掉期点						
1 个月期限	75	30.4	64	6	3	-52
2 个月期限	139	50	115	2	-10	-125
3 个月期限	202	48	163	-9	-26	-164
6 个月期限	379	175	305	-31	-62	-270
1 年期限	711	320	596	-54	-84	-402

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	6.3073	6.2670	6.2929	130	-2282	-33
2 个月期限	6.3150	6.2710	6.3029	120	-2329	16
3 个月期限	6.3250	6.2750	6.3130	98	-2352	69
6 个月期限	6.3470	6.3065	6.3329	115	-2500	126
1 年期限	6.3880	6.3480	6.3699	85	-2796	205

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。