

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年5月28日-6月1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（6月1日）报6.4078，较前周贬值约0.33%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.44%，上周最高6.3884、最低6.4339，收于6.4169，波幅为0.71%。上周主要受美元指数高位震荡等因素影响，境内人民币汇率走贬，但市场供求偏结汇，限制境内人民币汇率进一步走贬。预计本周人民币汇率仍将呈双边震荡走势，阻力位6.3800、支撑位6.4500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，短端掉期点冲高回落、长端掉期点震荡走升。短期限方面，次日期限掉期点上周一（5月28日）开盘在2.15位置，持续上行至上周三（5月30日）的15高位后缓慢回落，上周四（5月31日）下行到8.5附近交投，最终收于2.2附近。中长期方面，1年期掉期点上周一开在705位置后在短端带动下持续上升至上周三的高位741，随后在740附近窄幅震荡，最终收于740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上涨45个点，上周最高752、最低164，收于740，波幅为79.46%。

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122个点，上周最高6.5435、最低6.4840，收于6.5102，波幅为0.91%。

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	-	-	6.4078	211	-66	-1264
银行间市场汇价	6.4339	6.3884	6.4169	278	159	-951
掉期点						
1个月期限	87.2	71.4	84	12.6	6	-32
2个月期限	161	145	152	6	2	-88
3个月期限	228	137	221	13	10	-106
6个月期限	414	180	407	24	14	-168
1年期限	752	164	740	45	16	-258

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	6.4500	6.3955	6.4290	215	-921	37
2个月期限	6.4615	6.4075	6.4405	210	-953	84
3个月期限	6.4715	6.4175	6.4500	205	-982	110
6个月期限	6.4965	6.4380	6.4750	278	-1079	174
1年期限	6.5435	6.4840	6.5102	122	-1393	193

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。