

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年5月7日-5月11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（5月11日）报6.3524，与前周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.37%，上周最高6.3334、最低6.3830，收于6.3351，波幅为0.78%。上周主要受美元指数冲高回落影响，境内人民币汇率呈现先贬值后升值的走势。预计本周人民币汇率仍将维持区间震荡的走势，阻力位6.3800，支撑位6.3200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期曲线较前周变陡上移。短期限方面，银行间市场资金面整体维持宽松态势，掉期点变动区间较窄，上周五跨周末的隔夜期限掉期点变动较大，一度被打压至3附近。中长期方面，保持整体上行态势，上周四（5月10日）曾一度成交在690水位，但未突破700关口，随后开始下行。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50个点，上周最高709、最低635，收于680，波幅为10.88%。
- 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）较前周下跌195个点，上周最

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。

高 6.4885、最低 6.4225，收于 6.4375，波幅为 1.03%。

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	—	—	6.3524	3	131	-1818
银行间市场汇价	6.3830	6.3334	6.3351	-238	-88	-1769
掉期点						
1 个月期限	76	46	61	1	-11	-55
2 个月期限	150	120	131	6	-2	-109
3 个月期限	214	160	189	19	0	-138
6 个月期限	387	311	362	37	-4	-213
1 年期限	709	635	680	50	-22	-318

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	6.4000	6.3345	6.3475	-255	-1736	63
2 个月期限	6.4105	6.3460	6.3588	-217	-1770	106
3 个月期限	6.4215	6.3557	6.3687	-223	-1795	147
6 个月期限	6.4445	6.3785	6.3920	-220	-1909	207
1 年期限	6.4885	6.4225	6.4375	-195	-2120	344

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。