工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2018 年 6 月 11 日-6 月 15 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 15 日）报 6.4306，较前周贬值约 0.47%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.11%，上周最高 6.3895、最低 6.4370，收于 6.4168，波幅为 0.74%。上周主要受美联储及欧央行货币政策会议等因素影响，境内人民币汇率先升后贬。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，各期限掉期点走低后回升。中长期限方面，上周前两个交易日，1 年期掉期点延续前周区间震荡走势；上周三（6 月 13 日），掉期点下行 20-30 点，最低成交至 670，但随后市场进行回调，价格重回 700 上方；上周四（6 月 14 日），欧央行货币政策会议超市场预期的鸽派言论使得欧元下跌并持续走低，美元指数上涨，对掉期点有一定支撑。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 55 个点，上周最高 775、最低 670，收于 715，波幅为 14.69%。

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310个点，上周最高6.5450、最低6.4772，收于6.5420，波幅为1.04%。

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	-	-	6.4306	303	162	-1036
银行间市场汇价	6.4370	6.3895	6.4168	71	158	-952
掉期点						
1个月期限	98.05	29	86	-12	8	-30
2个月期限	197	146.50	155	-20.75	5	-85
3个月期限	232	198	220	-19	9	-107
6个月期限	565	360	400	-30	7	-175
1年期限	775	670	715	-55	-9	-283

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	6.4525	6.3970	6.4500	340	-711	246
2个月期限	6.4633	6.4078	6.4608	338	-750	285
3个月期限	6.4735	6.4050	6.4720	350	-762	332
6个月期限	6.4980	6.4347	6.4950	320	-879	382
1年期限	6.5450	6.4772	6.5420	310	-1075	537

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。