

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年8月6日-8月10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（8月10日）报6.8395，较前周贬值约0.11%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.07%，上周最高6.7950、最低6.8637，收于6.8574，波幅为1.00%。上周境内人民币汇率呈现宽幅震荡走势，主要受央行对远期购汇重新加收20%风险准备金的提振，但市场资金面仍相对宽松等因素的压制。预计本周人民币汇率可能维持在年内低位宽幅震荡的格局，主要波动区间在6.7500-6.9000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投清淡，各期限掉期点整体呈现宽幅震荡走势。中长期方面，1年期掉期点价格从-170下跌至周内低位-260，随后区间震荡交投，临近周末小幅冲高回落。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90个点，上周最高-210、最低-390，收于-260，波幅为-69.23%。
- 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118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 6.9110、最低 6.8412，收于 6.8955，波幅为 1.01%。

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	—	—	6.8395	73	230	3053
银行间市场汇价	6.7950	6.8637	6.8574	-46	393	3454
掉期点						
1 个月期限	-15	-80	-17	-2	-16	-133
2 个月期限	-20.8	-80	-37.21	-17.21	-32.21	-277.21
3 个月期限	-50	-130	-60	-25	-45	-387
6 个月期限	-90	-225	-140	-59	-115	-715
1 年期限	-210	-390	-260	-90	-205	-1258

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	6.8875	6.8008	6.8620	193	3409	65
2 个月期限	6.8915	6.8040	6.8680	188	3322	143.21
3 个月期限	6.8820	6.8090	6.8740	183	3258	224
6 个月期限	6.9070	6.8200	6.8825	168	2996	391
1 年期限	6.9110	6.8412	6.8955	118	2460	641

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。