

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年8月13日-8月17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17日）报6.8894，较前周贬值约0.73%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.35%，上周最高6.8630、最低6.9350，收于6.8815，波幅为1.05%。上周境内人民币汇率呈低位宽幅震荡格局，主要受土耳其里拉危机缓解、中美贸易战重启谈判等因素影响。预计本周人民币汇率可能仍然维持宽幅震荡的格局，交投区间主要集中在6.8000-6.9000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，整体呈现震荡上行走势。截至上周五16:30，掉期曲线较前周上移。中长期方面，1年期掉期点价格在上周前两个交易日区间震荡交投，临近周末上涨至-100。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160个点，上周最高-85、最低-290，收于-100，波幅为190%。
- 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30个点，上周最高6.9940、最低6.8878，收于6.8925，波幅为1.54%。

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。

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	—	—	6.8894	499	729	3552
银行间市场汇价	6.9350	6.8630	6.8815	241	634	3695
掉期点						
1 个月期限	-5	-50	-8	11	-7	-124
2 个月期限	-14.65	-58	-15	22.21	-106	-255
3 个月期限	-25	-80	-25	28	-15	-357
6 个月期限	-30	-150	-64	75	-40	-640
1 年期限	-100	-290	-100	160	-45	-1098

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	6.9520	6.8340	6.8395	-225	3184	-462
2 个月期限	6.9580	6.8420	6.8470	-210	3112	-380
3 个月期限	6.9660	6.8485	6.8535	-205	3053	-300
6 个月期限	6.9760	6.8623	6.8670	-155	2841	-130
1 年期限	6.9940	6.8878	6.8925	-30	2430	210

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。