

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年8月20日-8月24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24日）报6.8710，较前周升值约0.27%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.04%，上周最高6.8190、最低6.8916，收于6.8789，波幅为1.06%。上周境内人民币呈先升后贬走势，主要受中美重启贸易磋商、美元指数走弱、市场出现买盘力量等因素影响。预计本周人民币汇率可能仍然维持宽幅震荡态势，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，整体呈震荡下行走势。中长期限方面，1年期掉期点价格在上周前四个交易日呈下行走势，上周五早盘开在-280的位置，随后走升并围绕（-230，-200）区间震荡交投。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100个点，上周最高-67.5、最低-290，收于-200，波幅为111.25%。
- 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294个点，上周最高6.9595、最低6.8554，收于6.8631，波幅为1.52%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.8710	-184	545	3368
银行间市场汇价	6.8190	6.8916	6.8789	-26	608	3669
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	0.5	-23	-16	-8	-15	-132
2 个月期限	-12	-45	-33	-18	-124	-273
3 个月期限	-10	-75	-51	-21	-36	-378
6 个月期限	-28	-160	-104	-39	-79	-679
1 年期限	-67.5	-290	-200	-100	-145	-1190

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	6.8985	6.8005	6.8101	-294	2890	-72.57
2 个月期限	6.9050	6.8074	6.8166	-304	2808	9
3 个月期限	6.9165	6.8135	6.8231	-304	2749	92
6 个月期限	6.9285	6.8279	6.8361	-309	2532	275
1 年期限	6.9595	6.8554	6.8631	-294	2136	696

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。