

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年9月3日-9月7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（9月7日）报 6.8212，较前周升值约 0.05%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.10%，上周最高 6.8050、最低 6.8492，收于 6.8379，波幅为 0.65%。上周境内人民币汇率呈现小幅震荡贬值走势。预计本周人民币汇率可能仍然维持宽幅震荡格局，交投区间主要集中在 6.8200-6.8500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，整体呈震荡上行走势。中长期限方面，上周前三个交易日市场成交水平基本与前周持平，1年期掉期点基本围绕-170 的位置震荡交投，但上周最后两个交易日出现了较为快速的上行，上周五围绕-50 至 0 点区间反复交投。截至上周五 16:30，1年期美元对人民币掉期点较前周上涨 181 个点，上周最高 25、最低-191，收于 25，波幅为 864.00%。
- 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 454 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 6.9550、最低 6.8743，收于 6.9423，波幅为 1.16%。

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	—	—	6.8212	-34	-34	2870
银行间市场汇价	6.8492	6.8050	6.8379	69	69	3259
掉期点						
1 个月期限	16	-40	14.5	9	9	-106
2 个月期限	20	-5	20	28	28	-220
3 个月期限	16.5	-25	12	36	36	-313
6 个月期限	20	-91	20	90	90	-555
1 年期限	25	-191	25	181	181	-982

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	6.8840	6.8228	6.8803	379	3592	301
2 个月期限	6.8940	6.8298	6.8898	414	3540	386
3 个月期限	6.9020	6.8363	6.8968	424	3486	462
6 个月期限	6.9215	6.8520	6.9138	444	3309	626
1 年期限	6.9550	6.8743	6.9423	454	2928	906

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。