

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年9月17日-9月21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21日）报6.8357，较前周升值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.42%，上周最高6.8340、最低6.8470，收于6.8390，波幅为0.19%。上周境内人民币汇率呈小幅震荡贬值走势。预计本周人民币汇率可能仍然维持宽幅震荡的格局，交投区间主要集中在6.8000-6.8800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投非常活跃，呈现冲高回落走势。上周前三个交易日市场整体小幅震荡，一年期掉期点在20至50的区间内窄幅震荡交投，市场缺乏明确的方向预期。上周四（9月20日），掉期点小幅上行，从50点的低位快速上升至79，但是距离阻力位100仍有一定距离，随后下行至55的位置；上周五（9月21日）开盘后市场延续下跌态势，但在30位置构成一定支撑。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5个点，上周最高78、最低19，收于30，波幅为196.67%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较前周下跌 230 个点，上周最高 6.9750、最低 6.9019，收于 6.9410，波幅为 1.05%。

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	-	-	6.8357	-5	111	3015
银行间市场汇价	6.8470	6.8340	6.8390	-290	80	3270
掉期点						
1 个月期限	32	7	24.1	1.9	23.1	-91.9
2 个月期限	42	24	28.1	6.1	36.1	-211.9
3 个月期限	50.16	17.5	29	-1	51	-298
6 个月期限	65.5	17	31.6	6.6	101.6	-543.4
1 年期限	78	19	30	-5	203	-960

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	6.8997	6.8354	6.8640	-190	3429	225.9
2 个月期限	6.9115	6.8470	6.8770	-165	3412	351.9
3 个月期限	6.9209	6.8570	6.8865	-165	3383	446
6 个月期限	6.9412	6.8750	6.9100	-135	3271	678.4
1 年期限	6.9750	6.9019	6.9410	-230	2915	990

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。