

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年10月29日-11月2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（11月2日）报6.9371，较前周升值约0.20%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.84%，上周最高6.8730、最低6.9780，收于6.8897，波幅为1.52%。上周境内人民币汇率呈震荡升值走势。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6.8600-6.9200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，呈震荡上行走势。上周一（10月29日），市场交投活跃程度一般，观望情绪浓厚，银行间资金价格下行，各期限掉期点小幅震荡；上周二（10月30日），市场交投清淡，买盘较少，资金利率下行，各期限掉期点与前一交易日基本持平；上周三（10月31日），跨月资金有所收紧，买盘兴趣浓厚，各期限掉期点有所上行；上周四（11月1日），1-3个月买盘兴趣比较活跃，短端掉期点带动长端掉期点上行；上周五，短端掉期点买盘活跃度有所下降，长端掉期点仍存在部分外资买盘，各期限掉期点继续上行。截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期

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。

点较前周上涨 6 个点，上周最高-48、最低-116，收于-69，波幅为 98.55%。

- 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 908 个点，上周最高 7.0681、最低 6.9140，收于 6.9488，波幅为 2.22%。

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	—	—	6.9371	-139	-275	4029
银行间市场汇价	6.9780	6.8730	6.8897	-581	-843	3777
掉期点						
1 个月期限	9	-10	8	0.49	2	-108
2 个月期限	13.50	-12	11	4	4	-229
3 个月期限	34	-21	14	12.14	4	-313
6 个月期限	5	-45	-5	36	7	-580
1 年期限	-48	-116	-69	6	11	-1067

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	6.9815	6.8540	6.8990	-561	3779	85
2 个月期限	6.9955	6.8630	6.9090	-596	3732	182
3 个月期限	7.0075	6.8715	6.9180	-621	3698	269
6 个月期限	7.0330	6.8895	6.9380	-671	3551	488
1 年期限	7.0681	6.9140	6.9488	-908	3165	660

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。