

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年11月12日-11月16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16日）报6.9377，较前周贬值约0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.05%，上周最高6.9284、最低6.9703，收于6.9474，波幅为0.60%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势。预计本周人民币汇率可能维持宽幅震荡格局，交投区间主要集中在6.9000-6.9700。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，呈冲高回落走势。上周一（11月12日），央行暂停逆回购操作，市场交投清淡，各期限掉期点有所上行；上周二（11月13日），市场交投一般活跃，各期限掉期点较前一交易日小幅上行；上周三（11月14日），各期限掉期点高开高走，市场买盘力量较强，各期限掉期点小幅上行；上周四（11月15日），各期限掉期点延续上行走势；上周五，市场交投一般活跃，流动性一般，长端掉期点有所下行。截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上涨46个点，上周最高-185、最低-325，收于-255，波幅为54.90%。

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。

- 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227个点，上周最高7.0457、最低6.9707，收于6.9818，波幅为1.07%。

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	-	-	6.9377	48	-269	4035
银行间市场汇价	6.9703	6.9284	6.9474	34	-266	4354
<b>掉期点</b>						
1个月期限	2	-10	-4	1	-10	-120
2个月期限	4	-15	-2	10.88	-9	-242
3个月期限	-7	-46.5	-20	10	-30	-347
6个月期限	-49	-114	-79	16	-67	-654
1年期限	-185	-325	-255	46	-175	-1253

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	6.9795	6.9145	6.9240	-260	4029	-230
2个月期限	6.9890	6.9243	6.9338	-257	3980	-134
3个月期限	6.9980	6.9329	6.9430	-245	3948	-24
6个月期限	7.0160	6.9494	6.9595	-245	3766	200
1年期限	7.0457	6.9707	6.9818	-227	3323	599

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。