

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2018年10月8日-10月12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（10月12日）报6.9120，较9月28日贬值约0.48%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月28日贬值约0.48%，上周最高6.8875、最低6.9336，收于6.9146，波幅为0.67%。上周境内人民币汇率呈震荡贬值走势。预计本周人民币汇率可能继续维持宽幅震荡的格局，交投区间主要集中在6.8500-6.9500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点震荡走高。受央行公布的降准消息影响，中长期方面，1年期掉期点上周一（10月8日）开在-24的位置；上周二（10月9日）走低至-65，随后震荡走升并收在-20的位置；上周最后三个交易日，市场相对平静，掉期点在-10到20的区间内窄幅震荡。截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较9月28日下跌16个点，上周最高15、最低-60，收于4，波幅为1875.00%。
- 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9月28日上涨545个点，上

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。

周最高 7.0585，最低 6.9670，收于 7.0205，波幅为 1.30%。

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	—	—	6.9120	328	328	3778
银行间市场汇价	6.9336	6.8875	6.9146	421	421	4026
掉期点						
1 个月期限	9	-7	7	-1	-1	-109
2 个月期限	13	-15	9	-1	-1	-231
3 个月期限	15	-21	8	-6.5	-6.5	-319
6 个月期限	14	-35	5	-12.5	-12.5	-570
1 年期限	15	-60	4	-16	-16	-994

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	6.9660	6.8720	6.9219	369	4008	67
2 个月期限	6.9840	6.8900	6.9379	385	4021	227
3 个月期限	6.9975	6.9040	6.9512	417	4030	358
6 个月期限	7.0245	6.9355	6.9796	479	3967	644
1 年期限	7.0585	6.9670	7.0205	545	3710	1054

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。