



汇率简报

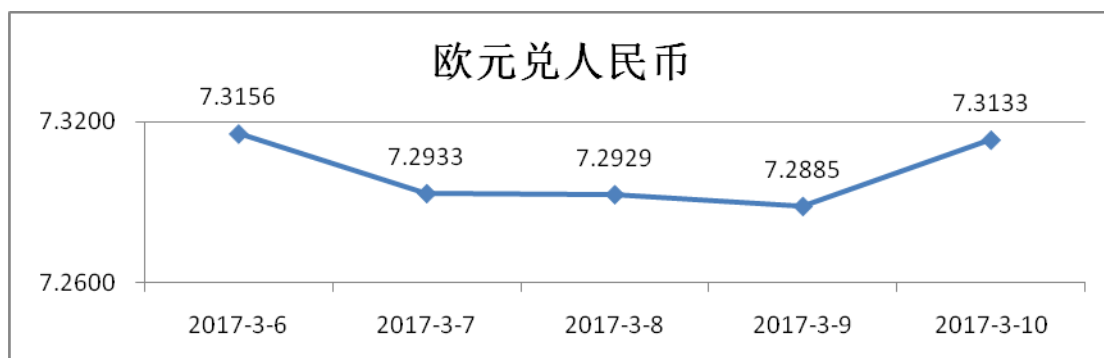
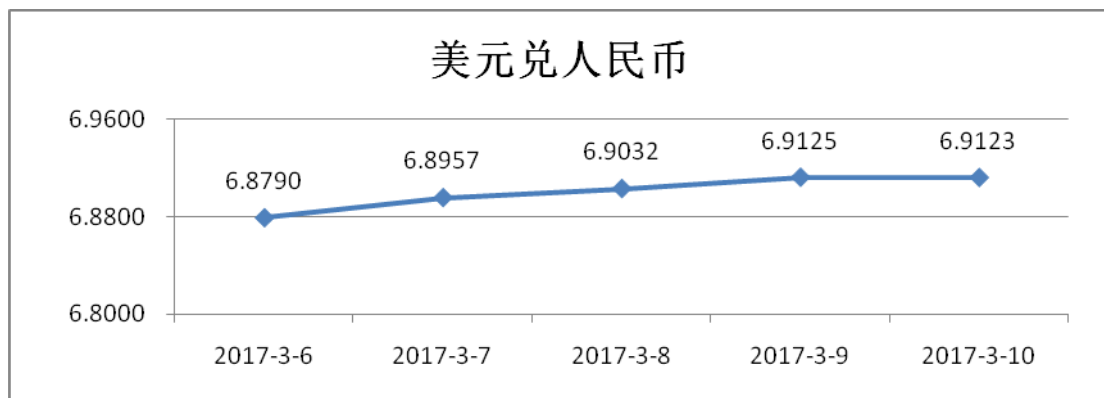
京能集团财务有限公司

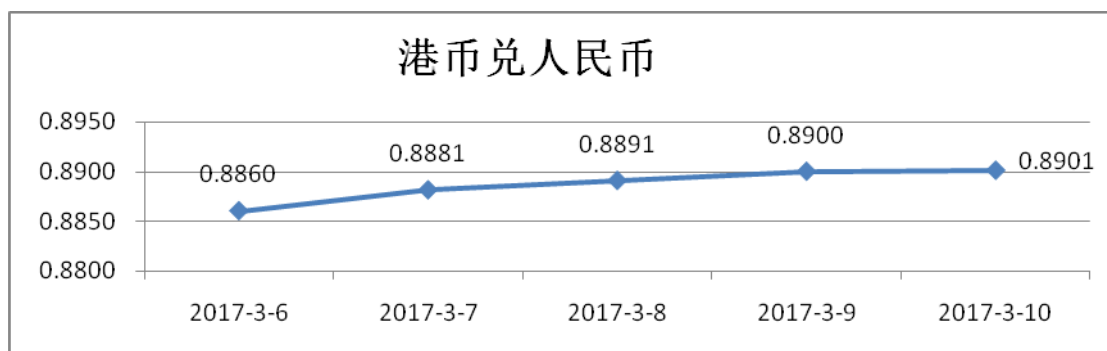
2017年第9期总第38期

一、一周外汇业务报价

(一) 一周中国外汇交易中心中间价

日期	美元兑人民币	欧元兑人民币	港币兑人民币
2017-3-6	6.8790	7.3156	0.8860
2017-3-7	6.8957	7.2933	0.8881
2017-3-8	6.9032	7.2929	0.8891
2017-3-9	6.9125	7.2885	0.8900
2017-3-10	6.9123	7.3133	0.8901





(二) 2017年3月10日汇率数据

	即期	3 个月远期	6 个月远期
美元兑人民币	6.9123	6.956	6.9901
欧元兑人民币	7.3133	7.404	7.4767
港币兑人民币	6.0042	6.0653	6.1247

注 1：即期汇率为当日人民币汇率中间价，该价格由银行间外汇市场主要做市商报价形成。

注 2：3 个月、6 个月远期汇率为银行间外汇市场 11:30 最优买卖报价的中值。

(三) CFETS人民币汇率指数

2017 年 2 月 28 日，CFETS 人民币汇率指数为 93.84，较今年 1 月末下跌 0.40%；参考 BIS 货币篮子和 SDR 货币篮子的人民币汇率指数分别为 95.10 和 95.79，分别较 1 月末下跌 0.48%和上涨 0.46%。三个人民币汇率指数与上月末相比两贬一升，但变动幅度不大，基本保持平稳运行。从波动率看，2 月份 CFETS 人民币汇率指数的年化波动率为 2.31%，低于人民币兑美元汇率中

间价 2.95%的年化波动率，人民币对一篮子货币汇率继续保持基本稳定。

2 月份以来，随着我国各项经济数据继续改善，以及人民币对美元汇率双向浮动弹性的增强，人民币贬值预期进一步有所收敛，市场对人民币汇率走势的看法出现分化。在此背景下，尽管受特朗普税收言论、美联储 3 月加息预期升温及欧洲选情变化等影响，美元指数震荡上升，但人民币对美元汇率仍在双向浮动中平稳运行。2 月 28 日人民币兑美元汇率中间价为 6.8750 元，较 1 月末贬值 0.24%；人民币对美元市场汇率收于 6.8689 元，较 1 月末升值 0.13%。

未来国际市场将继续受特朗普政策、美联储加息及国际政治经济领域中可能出现“黑天鹅”事件的影响，虽然仍有一些不确定性，但国内经济运行中的积极变化和亮点逐步增多，基本面因素将继续支撑人民币作为稳定的强势货币，人民币汇率将继续在合理均衡水平上保持基本稳定，并根据国际汇市和市场供求变化增强弹性，双向浮动。