

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年3月16日-3月20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（3月20日）报 7.1052，较前周贬值约 1.43%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 1.04%，上周最高 6.9850、最低 7.1238，收于 7.0661，波幅为 1.96%。上周境内人民币汇率呈现震荡贬值走势。预计本周人民币汇率或仍将维持区间震荡格局，交投区间主要集中在 7.0500-7.1300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，各期限掉期点震荡下行，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下行 153 个点，上周最高 860、最低 367，收于 597，波幅为 82.58%。
- 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）较前周上行 755 个点，上周最高 7.2295、最低 7.0751，收于 7.1930，波幅为 2.15%。

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。

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	—	—	7.1052	1019	986	1290
银行间市场汇价	7.1238	6.9850	7.0661	735	765	999
掉期点						
1 个月期限	48	-75	3	-37.50	-34	-75
2 个月期限	97	-25	15	-75	-57	-103
3 个月期限	170	-15	40	-113	-70	-125.50
6 个月期限	355	80	196	-142	-50	-69
1 年期限	860	367	597	-153	42	139

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	7.1550	6.9905	7.1179	972	1553	515
2 个月期限	7.1635	6.9985	7.1264	966	1578	588
3 个月期限	7.1705	7.0065	7.1334	956	1583	633
6 个月期限	7.1895	7.0299	7.1569	951	1664	712
1 年期限	7.2295	7.0751	7.1930	755	1660	672

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。