

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年2月3日-2月7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（2月7日）报6.9768，较上月末（1月23日）贬值约1.28%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上月末贬值约0.80%，上周最高6.9589、最低7.0268，收于6.9860，波幅为0.97%。上周境内人民币汇率呈现区间震荡走势。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6.9000-7.0500。
- 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上月末下行109个点，上周最高530、最低454，收于456，波幅为16.67%。
- 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）较前周下行27个点，上周最高7.1018、最低7.0134，收于7.0729，波幅为1.25%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.9768	—	892	6
银行间市场汇价	7.0268	6.9589	6.9860	—	560	198
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	58	33.80	33.80	—	-22.20	-44.20
2 个月期限	100	74	74	—	-38	-44
3 个月期限	150	94	112	—	-51	-53.50
6 个月期限	250	209	210	—	-78.50	-55
1 年期限	530	454	456	—	-109	-2

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	7.0328	6.9553	7.0044	38	418	150.20
2 个月期限	7.0443	6.9628	7.0136	20	450	202.00
3 个月期限	7.0468	6.9698	7.0206	15	455	234.00
6 个月期限	7.0703	6.9858	7.0369	-2	464	299.00
1 年期限	7.1018	7.0134	7.0729	-27	459	413.00

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。