

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年2月10日-2月14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14日）报6.9843，较前周贬值约0.11%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.09%，上周最高6.9586、最低7.0020，收于6.9795，波幅0.62%。上周境内人民币汇率呈区间震荡走势。预计本周阻力位6.9500，支撑位7.0200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，呈震荡下行走势。上周一（2月10日），市场交投比较清淡，各期限掉期点小幅震荡；上周二（2月11日），市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡上行；上周最后三个交易日，受市场资金面持续宽松影响，各期限掉期点震荡下行。截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行20个点，上周最高510、最低405，收于436，波幅24.08%。
- 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132个点，上周最高7.0795、最低7.0203，收于7.0597，波幅0.84%。

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	—	—	6.9843	75	967	81
银行间市场汇价	7.0020	6.9586	6.9795	-65	495	133
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	45	14	18	-15.8	-38	-60
2 个月期限	119	0	50	-24	-62	-68
3 个月期限	124	0	79	-33	-83	-86.5
6 个月期限	245	120	190	-20	-102	-75
1 年期限	510	405	436	-20	-129	-22

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	7.0114	6.9535	6.9912	-132	286	99.00
2 个月期限	7.0199	6.9620	6.9995	-141	309	150.00
3 个月期限	7.0269	6.9700	7.0065	-141	314	191.00
6 个月期限	7.0439	6.9825	7.0240	-129	335	255.00
1 年期限	7.0795	7.0203	7.0597	-132	327	366.00

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。