

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年3月23日-3月27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27日）报7.0427，较前周升值约0.89%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.38%，上周最高7.0491、最低7.1233，收于7.0928，波幅为1.05%。上周境内人民币汇率宽幅震荡后有所走贬。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297个点，上周最高550、最低110，收于300，波幅为146.67%。
- 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497个点，上周最高7.2260、最低7.1064，收于7.1433，波幅为1.67%。

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	—	—	7.0427	-625	361	665
银行间市场汇价	7.1233	7.0491	7.0928	267	1032	1266
掉期点						
1个月期限	-5	-125	-51.50	-54.50	-88.50	-129.50
2个月期限	25.50	-130	-42	-57	-114	-160
3个月期限	13.70	-150	-18	-58	-128	-183.50
6个月期限	160	-85	70	-126	-176	-195
1年期限	550	110	300	-297	-255	-158

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	7.1530	7.0417	7.0754	-425	1128	-123
2个月期限	7.1595	7.0482	7.0829	-435	1143	-57
3个月期限	7.1635	7.0537	7.0884	-450	1133	-26
6个月期限	7.1815	7.0717	7.1028	-541	1123	30
1年期限	7.2260	7.1064	7.1433	-497	1163	205

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。