

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年7月6日-7月10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（7月10日）报6.9943，较前周升值约0.99%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.87%，上周最高6.9820、最低7.0644，收于7.0071，波幅为1.18%。上周境内人民币汇率震荡走升，主要受国内股市上涨吸引外部资金流入、中美利差进一步展宽等因素影响。预计本周人民币汇率将维持区间震荡，交投区间主要集中在6.9600-7.0400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点有所上行，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上行211个点，上周最高1260、最低1050，收于1231，波幅为17.06%。
- 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412个点，上周最高7.1590、最低7.1210，收于7.1468，波幅为0.53%。

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	—	—	6.9943	-695	-1373	181
银行间市场汇价	7.0644	6.9820	7.0071	-609	-1384	409
掉期点						
1 个月期限	152	115	130	15	9	52
2 个月期限	256	105	245	26	30	127
3 个月期限	370	322	350	28	13	184.50
6 个月期限	692	600	667	112	107	402
1 年期限	1260	500	1231	211	216	773

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	7.0320	6.9960	7.0173	-537	547	-28
2 个月期限	7.0440	7.0055	7.0298	-522	612	-18
3 个月期限	7.0560	7.0195	7.0423	-522	672	2
6 个月期限	7.0910	7.0520	7.0780	-485	875	42
1 年期限	7.1590	7.1210	7.1468	-412	1198	166

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。