

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年7月13日-2020年7月17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17日）报7.0043，较前周贬值约0.14%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.10%，上周最高6.9830、最低7.0199，收于7.0002，波幅为0.53%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受国内经济不断回暖、国外疫情进一步发酵等因素影响。预计本周人民币汇率维持双向浮动，交投区间主要集中在6.9500-7.0500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点窄幅震荡，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27个点，上周最高1280、最低1230，收于1258，波幅为3.97%。
- 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217个点，上周最高7.1019，最低7.1609，收于7.1251，波幅为0.83%。

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	—	—	7.0043	100	-1273	281
银行间市场汇价	7.0199	6.9830	7.0002	-69	-1453	340
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	171	128	129	-1	8	51
2 个月期限	255	236	241	-4	26	123
3 个月期限	366	119	354	4	17	188
6 个月期限	690	659	669	2	109	404
1 年期限	1280	1230	1258	27	243	800

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	6.9779	6.9971	-202	345	-160
2 个月期限	7.0460	6.9879	7.0096	-202	410	-147
3 个月期限	7.0577	6.9999	7.0216	-207	465	-140
6 个月期限	7.0927	7.0356	7.0571	-209	666	-100
1 年期限	7.1609	7.1019	7.1251	-217	981	-9

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。