

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年7月27日-7月31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31日）报6.9848，较前周升值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.53%，上周最高6.9713、最低7.0103，收于6.9794，波幅为0.56%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受美元指数持续下跌、境内股市有所反弹等因素影响。预计本周人民币汇率震荡升值，美国疫情严重可能使得美元指数维持弱势，叠加中美利差处于高位，人民币汇率有望继续保持强势，交投区间主要集中在6.9400-7.0000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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82个点，上周最高1388、最低1270，收于1380，波幅为8.55%。
- 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289个点，上周最高7.1650、最低7.1067，收于7.1308，波幅为0.82%。

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	—	—	6.9848	-90	-1468	86
银行间市场汇价	7.0103	6.9713	6.9794	-368	-1661	132
<b>掉期点</b>						
1个月期限	153	131	150	10	29	72
2个月期限	311	245	308	51	93	190
3个月期限	411	361	411	41	74	245
6个月期限	763	0	758	54	198	493
1年期限	1388	1270	1380	82	365	922

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	7.0365	6.9722	6.9986	-246	360	42
2个月期限	7.0450	6.9860	7.0090	-281	404	-12
3个月期限	7.0570	6.9980	7.0223	-271	472	18
6个月期限	7.0950	7.0352	7.0593	-286	688	41
1年期限	7.1650	7.1067	7.1308	-289	1038	134

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。