

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年8月10日-8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（8月14日）报6.9405，与前周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.14%，上周最高6.9301、最低6.9728，收于6.9498，波幅为0.61%。上周境内人民币汇率震荡走升，主要受美元指数走弱等因素影响。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6.9100-6.9700。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅震荡，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下行74个点，上周最高1515、最低1322，收于1386，波幅为13.92%。
- 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163个点，上周最高7.1327、最低7.0740，收于7.1057，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)
即期汇率						
中间价	—	—	6.9405	-3	-443	-357
银行间市场汇价	6.9728	6.9301	6.9498	-100	-296	-164
掉期点						
1 个月期限	157	128	141	-2	-9	63
2 个月期限	306	285	295	-6	-13	177
3 个月期限	435	382	406	-12	-5	240
6 个月期限	835	0	766	-49	8	501
1 年期限	1515	1322	1386	-74	6	928

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	6.9855	6.9250	6.9516	-246	-110	-123
2 个月期限	6.9982	6.9400	6.9661	-267	-25	-132
3 个月期限	7.0125	6.9550	6.9806	-246	55	-98
6 个月期限	7.0561	6.9975	7.0228	-259	323	-36
1 年期限	7.1327	7.0740	7.1057	-163	787	173

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。