

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年8月17日-8月21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21日）报6.9107，较前周升值约0.43%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.52%，上周最高6.8960、最低6.9479，收于6.9136，波幅为0.75%。上周境内人民币汇率震荡走升，主要受美国疫情持续扩散、我国加大稳外贸工作力度等因素影响。预计本周人民币汇率震荡走升，整体在6.8500-6.9700区间浮动。
- 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上行5个点，上周最高1425、最低1368，收于1391，波幅为4.10%。
- 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424个点，上周最高7.0993、最低7.0358，收于7.0633，波幅为0.90%。

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	—	—	6.9107	-298	-741	-655
银行间市场汇价	6.9479	6.8960	6.9136	-362	-658	-526
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	161	74.7	144	3	-6	66
2 个月期限	310	0	295	0	-13	177
3 个月期限	440	115	409	3	-2	243
6 个月期限	803	757.36	780.79	14.79	22.79	515.79
1 年期限	1425	1368	1391	5	11	933

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	6.9540	6.8918	6.9310	-206	-316	30
2 个月期限	6.9695	6.9063	6.9450	-211	-236	19
3 个月期限	6.9843	6.9198	6.9595	-211	-156	50
6 个月期限	7.0310	6.9598	7.0000	-228	95	83
1 年期限	7.0993	7.0358	7.0633	-424	363	106

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。