

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年9月7日-9月11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（9月11日）报6.8389，较前周贬值约0.04%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.01%，上周最高6.8259、最低6.8565，收于6.8389，波幅为0.45%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受我国出口数据持续向好、美元指数震荡攀升等因素影响。预计本周人民币汇率震荡走升，交投区间主要集中在6.7800-6.8800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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21个点，上周最高1496、最低1447，收于1486，波幅为3.30%。
- 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24个点，上周最高7.0211、最低6.9725，收于6.9922，波幅为0.70%。

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	—	—	6.8389	30	-216	-1373
银行间市场汇价	6.8259	6.8565	6.8389	-4	-146	-1273
<b>掉期点</b>						
1个月期限	175.5	153.1	163.8	-1.2	-29.2	85.8
2个月期限	310	295.8	306	3	3	188
3个月期限	435	0	430	5	13	264
6个月期限	826	0	825	21	57	560
1年期限	1496	1447	1486	21	61	1028

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	6.8700	6.8245	6.8446	2	-1180	-107
2个月期限	6.8830	6.8380	6.8582	-2	-1104	-113
3个月期限	6.8965	6.8520	6.8722	11	-1029	-97
6个月期限	6.9380	6.8696	6.9122	5	-783	-92
1年期限	7.0211	6.9725	6.9922	-24	-348	47

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。