

# 工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2020年9月28日-10月9日)

## ◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（10月9日）报6.7796，较前周升值约0.48%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约1.59%，最高6.6929、最低6.7345，收于6.7135，波幅为0.62%。境内人民币汇率小幅升值，主要受美元指数持续走软、双节假期间离岸人民币震荡走升等因素影响。预计下周人民币汇率区间震荡，交投区间主要集中在6.7041-6.8280。
- 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，截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行65个点，本周最高1618、最低1525，收于1609，波幅为5.78%。
- 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1219个点，本周最高6.9178，最低6.8366，收于6.8630，波幅为1.16%。

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	—	—	6.7796	-325	-305	-1966
银行间市场汇价	6.7345	6.6929	6.7135	-1067	-855	-2527
<b>掉期点</b>						
1个月期限	166	160	165	-37	6	87
2个月期限	312	305	312	-23	16	194
3个月期限	480	468	476	16	17	310
6个月期限	900	880	895	20	40	630
1年期限	1618	1525	1609	65	64	1151

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	6.7891	6.6904	6.7062	-1283	-2564	-238
2个月期限	6.7895	6.7017	6.7207	-1298	-2479	-240
3个月期限	6.8040	6.7139	6.7347	-1298	-2404	-264
6个月期限	6.8420	6.7547	6.7742	-1308	-2163	-288
1年期限	6.9178	6.8366	6.8630	-1219	-1640	-114

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。