

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年10月19日-10月23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（10月23日）报6.6703，较前周升值约0.94%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.44%，上周最高6.6400、最低6.7044，收于6.6690，波幅为0.97%。上周境内人民币汇率震荡走升，主要受中美利差维持高位、中国三季度经济数据向好、美元指数疲弱等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡走势，整体在6.6400-6.7600区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行，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43个点，上周最高1654、最低1590，收于1653，波幅为3.87%。
- 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286个点，上周最高6.8679、最低6.7882，收于6.8336，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)
即期汇率						
中间价	—	—	6.6703	-629	-1398	-3059
银行间市场汇价	6.7044	6.6400	6.6690	-292	-1300	-2972
掉期点						
1 个月期限	172	150	167	13.5	8	89
2 个月期限	319	295	315	10	19	197
3 个月期限	505	472	500	15	41	334
6 个月期限	923	877	923	40	68	658
1 年期限	1654	1590	1653	43	108	1195

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	6.7250	6.6420	6.6836	-280	-2790	-21
2 个月期限	6.7346	6.6554	6.6971	-295	-2715	-34
3 个月期限	6.7491	6.6676	6.7116	-301	-2635	-74
6 个月期限	6.8006	6.7090	6.7536	-286	-2369	-77
1 年期限	6.8679	6.7882	6.8336	-286	-1934	-7

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。