

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年9月14日-9月18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18日）报6.7591，较前周升值约1.18%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约1.19%，上周最高6.7501、最低6.8327，收于6.7588，波幅为1.22%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受我国宏观数据持续向好、美元指数承压运行等因素影响。预计本周人民币汇率稳中趋升，交投区间主要集中在6.6900-6.8000。
- 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11个点，上周最高1510、最低670，收于1497，波幅为56.11%。
- 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575个点，上周最高6.9955、最低6.8877，收于6.9347，波幅为1.55%。

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	—	—	6.7591	-798	-1014	-2171
银行间市场汇价	6.8327	6.7501	6.7588	-801	-947	-2074
<b>掉期点</b>						
1个月期限	231	145	166	2.2	-27	88
2个月期限	320	280	306	0	3	188
3个月期限	439	410	428	-2	11	262
6个月期限	835	116	823	-2	55	558
1年期限	1510	670	1497	11	72	1039

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	6.8452	6.7437	6.7897	-549	-1729	143
2个月期限	6.8594	6.7620	6.8042	-540	-1644	148
3个月期限	6.8736	6.7695	6.8167	-555	-1584	151
6个月期限	6.9127	6.8087	6.8563	-559	-1342	152
1年期限	6.9955	6.8877	6.9347	-575	-923	262

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。