

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年4月13日-4月17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（4月17日）报 7.0718，较前周贬值约 0.51%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.58%，上周最高 7.0400、最低 7.0840，收于 7.0764，波幅为 0.62%。上周境内人民币汇率区间波动。预计本周人民币汇率或仍将维持震荡格局，交投区间主要集中在 7.0500-7.1300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡下行，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下行 60 个点，上周最高 360、最低 262，收于 310，波幅为 31.61%。
- 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）较前周上行 453 个点，上周最高 7.1490、最低 7.0841，收于 7.1383，波幅为 0.91%。

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	—	—	7.0718	364	-133	956
银行间市场汇价	7.0840	7.0400	7.0764	413	-46	1102
掉期点						
1 个月期限	2	-14	-5	-5	28	-83
2 个月期限	1	-16	-4	-4.5	46	-122
3 个月期限	4	-17	-7	-14	22	-172.50
6 个月期限	80	25	52	-33	-33	-213
1 年期限	360	262	310	-60	-75	-148

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	7.0893	7.0259	7.0747	372	1121	-12
2 个月期限	7.0958	7.0340	7.0817	380	1131	57
3 个月期限	7.1008	7.0380	7.0872	387	1121	115
6 个月期限	7.1153	7.0525	7.1033	418	1128	217
1 年期限	7.1490	7.0841	7.1383	453	1113	309

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。