

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年4月6日-4月10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10日）报7.0354，较前周升值约1.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.78%，上周最高7.0275、最低7.0890，收于7.0351，波幅为0.87%。上周境内人民币汇率呈震荡升值走势。预计本周人民币汇率将宽幅震荡格局，交投区间主要集中在6.9800-7.1200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，各期限掉期点区间震荡。上周二（4月7日），受市场风险情绪回升等因素影响，各期限掉期点震荡下行；上周三（4月8日），受市场美元买盘涌现等因素影响，各期限掉期点震荡上行；上周四（4月9日），受流动性改善和交易商交投意愿回暖等因素影响，各期限掉期点小幅震荡；上周五，受复活节假日前夕美元指数交投清淡影响，各期限掉期点有所上行。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70个点，上周最高390、最低160，收于370，波幅为62.16%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行 800 个点，上周最高 7.1777、最低 7.0752，收于 7.0930，波幅为 1.45%。

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	—	—	7.0354	-750	-497	592
银行间市场汇价	7.0890	7.0275	7.0351	-552	-459	689
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	5	-20	0	40	33	-78
2 个月期限	10	-52	0.5	25.5	50.5	-117.5
3 个月期限	15	-48	7	37	36	-158.5
6 个月期限	100	5	85	55	0	-180
1 年期限	390	160	370	70	-15	-88

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	7.1097	7.0257	7.0375	-633	749	24
2 个月期限	7.1171	7.0354	7.0437	-641	751	86
3 个月期限	7.1222	7.0405	7.0485	-645	734	127
6 个月期限	7.1385	7.0534	7.0615	-695	710	179
1 年期限	7.1777	7.0752	7.0930	-800	660	209

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。