

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年6月22日-2020年6月24日)

## ◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周三（6月24日）报 7.0555，较前周升值约 0.51%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.05%，上周最高 7.0509、最低 7.0790，收于 7.0744，波幅为 0.40%。上周境内人民币汇率窄幅震荡，主要受美元指数有所走弱、端午假期前购汇较集中等因素影响。预计本周人民币汇率仍然维持双向浮动，交投区间主要集中在 7.0400-7.1200。
- 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，截至上周三 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 53 个点，上周最高 1190、最低 1010，收于 1040，波幅为 17.31%。
- 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 73 个点，上周最高 7.2124，最低 7.1633，收于 7.2077，波幅为 0.68%。

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	—	—	7.0555	-358	-761	793
银行间市场汇价	7.0790	7.0509	7.0744	-36	-711	1082
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	140.50	120	123	6	35.60	45
2 个月期限	235	207	214.78	11.78	63.78	96.78
3 个月期限	330	300	310	20.50	100	144.50
6 个月期限	570	0	555	32.50	155	290
1 年期限	1190	1010	1040	53	285	582

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	7.0940	7.0443	7.0892	39	1266	25
2 个月期限	7.1059	7.0534	7.1012	41	1326	53
3 个月期限	7.1165	7.0639	7.1117	171	1366	63
6 个月期限	7.1499	7.0949	7.1462	47	1557	163
1 年期限	7.2124	7.1633	7.2077	73	1807	293

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。