

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年6月29日-7月3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（7月3日）报 7.0638，较前周升值约 0.22%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.09%，上周最高 7.0571、最低 7.0830，收于 7.0680，波幅为 0.37%。上周境内人民币汇率震荡走升，受国内权益市场表现较好吸引外部资金流入、PMI 数据好于预期、经济增速有望继续恢复等因素影响。预计本周人民币汇率将维持区间震荡，交投区间主要集中在 7.0300-7.1000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点有所下行，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 20 个点，上周最高 1048、最低 980，收于 1020，波幅为 6.67%。
- 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 197 个点，上周最高 7.1990、最低 7.1778，收于 7.1880，波幅为 0.29%。

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	—	—	7.0638	-157	-678	876
银行间市场汇价	7.0830	7.0571	7.0680	-61	-775	1018
掉期点						
1 个月期限	129.52	106.59	115	-8	-6	37
2 个月期限	231	199.2	219	4.22	4	101
3 个月期限	355	219	322	12	-15	156.5
6 个月期限	580	225	555	0	-5	290
1 年期限	1048	980	1020	-20	5	562

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	7.0825	7.0666	7.0710	-182	1084	-85
2 个月期限	7.0960	7.0720	7.0820	-192	1134	-79
3 个月期限	7.1070	7.0848	7.0945	-172	1194	-57
6 个月期限	7.1380	7.1179	7.1265	-197	1360	30
1 年期限	7.1990	7.1778	7.1880	-197	1610	180

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。