

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年7月20日-2020年7月24日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（7月24日）报6.9938，较前周升值约0.15%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.23%，上周最高6.9649、最低7.0238，收于7.0162，波幅为0.84%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受中美关系紧张、提升市场避险情绪等因素影响。预计本周人民币汇率震荡贬值，中美关系趋于紧张，人民币汇率受到冲击高位回落，可能保持弱勢格局，交投区间主要集中在6.9700-7.1000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点小幅上行，截至上周五16:30，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行40个点，上周最高1310、最低1241，收于1298，波幅为5.32%。
- 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346个点，上周最高7.0848、最低7.1726，收于7.1597，波幅为1.23%。

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	—	—	6.9938	-105	-1378	176
银行间市场汇价	7.0238	6.9649	7.0162	160	-1293	500
掉期点						
1个月期限	150	127	140	11	19	62
2个月期限	262	241	257	16	42	139
3个月期限	377	350	370	16	33	204
6个月期限	705	645	704	35	144	439
1年期限	1310	1241	1298	40	283	840

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	7.0370	6.9612	7.0232	261	606	-70
2个月期限	7.0512	6.9729	7.0371	275	685	-32
3个月期限	7.0638	6.9849	7.0494	278	743	-38
6个月期限	7.1015	7.0217	7.0879	308	974	13
1年期限	7.1726	7.0848	7.1597	346	1327	137

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。