

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年10月12日-10月16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（10月16日）报6.7332，较前周升值约0.69%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.23%，上周最高6.6939、最低6.7612，收于6.6982，波幅为1.00%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受中美利差维持在高位、市场看涨人民币情绪浓厚等因素影响。预计本周人民币汇率震荡走升，受中美利差保持历史高位、客盘整体偏向结汇等因素影响，人民币汇率在短期内仍有升值动能，人民币汇率交投区间将主要集中在6.6400-6.7500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，掉期点区间震荡，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1个点，上周最高1720、最低143，收于1610，波幅为97.95%。
- 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95个点，上周最高6.9352、最低6.8430，收于6.8622，波幅为1.35%。

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	—	—	6.7332	-464	-769	-2430
银行间市场汇价	6.7612	6.6939	6.6982	-153	-1008	-2680
掉期点						
1 个月期限	185	150	153.50	-11.50	-5.50	75.50
2 个月期限	330	298.80	305	-7	9	187
3 个月期限	506	0	485	9	26	319
6 个月期限	936	0	883	-12	28	618
1 年期限	1720	143	1610	1	65	1152

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	6.7898	6.6988	6.7116	54	-2510	-20
2 个月期限	6.7977	6.7113	6.7266	59	-2420	-21
3 个月期限	6.8127	6.7259	6.7417	70	-2334	-50
6 个月期限	6.8557	6.7672	6.7822	80	-2083	-43
1 年期限	6.9352	6.8430	6.8622	95	-1648	30

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。