

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年10月26日-10月30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30日）报6.7232，较前周贬值约0.79%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.47%，上周最高6.6750、最低6.7308，收于6.7002，波幅为0.83%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受监管传达稳定汇率预期、美元指数小幅反弹等因素共同影响。预计本周人民币汇率区间宽幅震荡，交投区间主要集中在6.6500-6.7500。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点整体震荡上行，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27个点，上周最高1727、最低1660，收于1680，波幅为3.99%。
- 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303个点，上周最高6.9101、最低6.8167，收于6.8639，波幅为1.37%。

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	—	—	6.7232	529	-869	-2530
银行间市场汇价	6.7308	6.6750	6.7002	312	-988	-2660
掉期点						
1个月期限	196	155	164	-3	5	86
2个月期限	370	-160	359	44	63	241
3个月期限	541	498	520	20	61	354
6个月期限	975	930	930	7	75	665
1年期限	1727	1660	1680	27	135	1222

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	6.7576	6.6705	6.7119	283	-2507	-47
2个月期限	6.7715	6.6789	6.7264	293	-2422	-97
3个月期限	6.7890	6.6940	6.7409	293	-2342	-113
6个月期限	6.8310	6.7493	6.7829	293	-2076	-103
1年期限	6.9101	6.8167	6.8639	303	-1631	-43

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。