

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年8月3日-8月7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（8月7日）报6.9408，较前周升值约0.63%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.28%，上周最高6.9350、最低6.9875，收于6.9598，波幅为0.75%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受美元指数持续下跌、中美利差维持在高位等因素影响。预计本周人民币汇率震荡升值，美国宽松的货币政策以及疫情恶化态势将持续施压美元指数，但中美博弈事件或对汇率市场形成短期扰动，人民币汇率交投区间将主要集中在6.9100-6.9800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点短端下行、长端上行，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80个点，上周最高1545、最低1395，收于1460，波幅为10.27%。
- 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88个点，上周最高7.1454、最低7.0734，收于7.1220，波幅为1.01%。

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	—	—	6.9408	-440	-440	-354
银行间市场汇价	6.9875	6.9350	6.9598	-196	-196	-64
掉期点						
1 个月期限	169.26	140	143	-7	-7	65
2 个月期限	330	295	301	-7	-7	183
3 个月期限	449	418	418	7	7	252
6 个月期限	850	777.50	815	57	57	550
1 年期限	1545	1395	1460	80	80	1002

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	7.0065	6.9325	6.9762	-224	136	21
2 个月期限	7.0208	6.9455	6.9928	-162	242	29
3 个月期限	7.0376	6.9610	7.0052	-171	301	36
6 个月期限	7.0733	6.9999	7.0487	-106	582	74
1 年期限	7.1454	7.0734	7.1220	-88	950	162

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。