

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年8月24日-8月28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28日）报6.8891，较前周升值约0.31%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.71%，上周最高6.8605、最低6.9212，收于6.8651，波幅为0.88%。上周境内人民币汇率明显升值，主要受我国加大稳外贸工作力度、美元指数持续低位等因素影响。预计本周人民币汇率震荡走升，交投区间主要集中在6.8000-6.9300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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下行21个点，上周最高1393、最低1350，收于1370，波幅为3.14%。
- 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433个点，上周最高7.0770，最低7.0009，收于7.0200，波幅为1.08%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.8891	-216	-957	-871
银行间市场汇价	6.8605	6.9212	6.8651	-485	-1143	-1011
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	180	0	178	34	28	100
2 个月期限	290.01	144.25	282	-13	-26	164
3 个月期限	417.5	390	398	-11	-13	232
6 个月期限	780	656	740	-40.79	-18	475
1 年期限	1393	1350	1370	-21	-10	912

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	6.9344	6.8580	6.8730	-580	-896	-99
2 个月期限	6.9460	6.8685	6.8840	-610	-846	-93
3 个月期限	6.9600	6.8825	6.8980	-615	-771	-69
6 个月期限	6.9985	6.9215	6.9370	-630	-535	-21
1 年期限	7.0770	7.0009	7.0200	-433	-70	179

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。