

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年8月15日-8月19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19日）报6.8065，较前周贬值约0.96%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.97%，上周最高6.8150、最低6.7835，收于6.8088，波幅为0.46%。上周受7月我国外汇市场运行总体平稳、中美利差倒挂程度加深、美联储鹰派立场等因素影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国稳经济措施持续发力、美联储加息预期等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.7700-6.8500区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，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135个点，上周最高-880、最低-1005，收于-980，波幅为12.76%。
- 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845个点，上周最高6.7678、最低6.6630，收于6.7520，波幅为1.55%。

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	-	-	6.8065	652	628	4308
银行间市场汇价	6.8150	6.7835	6.8088	658	698	4358
掉期点						
1 个月期限	-67	-78	-74	0	-15	-263
2 个月期限	-147	-418	-149	5	-24	-445
3 个月期限	-237	-507	-239	2	-62	-669
6 个月期限	-505	-573	-520	-16	-158	-1320
1 年期限	-880	-1005	-980	-135	-410	-2474

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	6.8345	6.7254	6.8215	920	4456	201
2 个月期限	6.8315	6.7200	6.8177	937	4263	238
3 个月期限	6.8258	6.7150	6.8120	935	4076	271
6 个月期限	6.8038	6.6931	6.7894	924	3445	326
1 年期限	6.7678	6.6630	6.7520	845	2351	412

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。