

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年8月22日-8月26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26日）报6.8486，较前周贬值约0.61%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.78%，上周最高价6.8735、最低价6.8202，收于6.8621，波幅为0.78%。上周受8月以来银行结售汇和涉外收付款呈现双顺差局面、美联储释放鹰派立场等因素影响，人民币对美元汇率震荡贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济修复势头增强、国际收支状况有望保持顺差局面、美联储加息预期提振美元指数等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.8500~6.9500区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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下行92个点，上周最高价-980、最低价-1150，收于-1072，波幅为15.86%。
- 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545个点，上周最高价6.8147、最低价6.7420，收于6.8065，波幅为1.07%。

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	-	-	6.8486	421	1049	4729
银行间市场汇价	6.8735	6.8202	6.8621	533	1231	4891
掉期点						
1 个月期限	-62.50	-80	-64	10	-5	-253
2 个月期限	-149	-172	-152	-3	-27	-448
3 个月期限	-102	-271.51	-250	-11	-73	-680
6 个月期限	-520	-584	-530	-10	-168	-1330
1 年期限	-980	-1150	-1072	-92	-502	-2566

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	6.8865	6.8105	6.8815	600	5056	258
2 个月期限	6.8871	6.8070	6.8780	603	4866	311
3 个月期限	6.8815	6.8015	6.8725	605	4681	354
6 个月期限	6.8660	6.7780	6.8490	596	4041	399
1 年期限	6.8147	6.7420	6.8065	545	2896	516

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。