

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年9月19日-9月23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（9月23日）报6.9920，较前周贬值约0.88%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.32%，上周最高价7.1300、最低价6.9900，收于7.1104，波幅为1.97%。上周受俄乌冲突持续推升市场避险情绪、美联储大幅加息75BP、美元指数续创二十年新高等因素影响，人民币对美元汇率明显贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济基本面长期向好、央行上调远期售汇业务的外汇风险准备金率至20%等人民币升值因素，以及欧元区经济前景趋弱施压欧元、地缘政治风险高企等美元强势因素共同影响，在岸人民币对美元汇率将在7.0700~7.1800区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投活跃，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100个点，上周最高价-1360、最低价-1530，收于-1490，波幅为11.41%。
- 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862个点，上周最

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。

高价 7.0160、最低价 6.8780，收于 7.0000，波幅为 1.97%。

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	-	-	6.9920	615	1014	6163
银行间市场汇价	7.1300	6.9900	7.1104	938	2199	7374
掉期点						
1 个月期限	-26	-84.32	-55	6	18	-244
2 个月期限	-156	-180	-162	-4	-21	-458
3 个月期限	-204	-370	-270	-1	-29	-700
6 个月期限	-630	-678	-662	-70	-137	-1462
1 年期限	-1360	-1530	-1490	-100	-380	-2984

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	7.0946	6.9502	7.0748	1041	6989	-301
2 个月期限	7.1022	6.9565	7.0822	1058	6908	-120
3 个月期限	7.1013	6.9560	7.0816	1056	6772	-18
6 个月期限	7.0790	6.9364	7.0583	1004	6134	141
1 年期限	7.0160	6.8780	7.0000	862	4831	379

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。