

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年10月17日-10月21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（10月21日）报7.1186，较前周贬值约0.14%。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7.1090、最低7.2528，收于7.2494，波幅为1.98%。
- 人民币外汇掉期市场：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320个点，上周最高-2158、最低-2513，收于-2460，波幅为14.43%。
- 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102个点，上周最高7.1107、最低7.0092，收于7.0692，波幅为1.44%。

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	-	-	7.1186	98	188	7429
银行间市场汇价	7.2528	7.1090	7.2494	563	1563	8764
掉期点						
1 个月期限	-107	-151	-130	8	-40	-319
2 个月期限	-270	-320	-304	-5	-111	-600
3 个月期限	-485	-572	-530	-58	-226	-960
6 个月期限	-1070	-1210	-1141	-74	-430	-1941
1 年期限	-2158	-2513	-2460	-320	-865	-3954

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	7.2095	7.1184	7.1697	207	7938	-667
2 个月期限	7.2135	7.1204	7.1735	220	7821	-455
3 个月期限	7.2145	7.1189	7.1745	235	7701	-219
6 个月期限	7.1841	6.8940	7.1397	177	6948	44
1 年期限	7.1107	7.0092	7.0692	102	5523	658

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。