

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年10月24日-10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（10月28日）报7.1698，较前周贬值约0.71%。银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.10%，上周最高7.1600、最低7.3100，收于7.2565，波幅为2.07%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期掉期点较前周上行130个点，上周最高-2165、最低-2406，收于-2330，波幅为10.34%。
- 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288个点，上周最高7.2234、最低7.0055，收于7.0980，波幅为3.07%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	7.1698	512	700	7941
银行间市场汇价	7.3100	7.1600	7.2565	71	1634	8835
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	-109	-140	-129	1	-39	-318
2 个月期限	-116	-310	-305	-1	-112	-601
3 个月期限	-182	-523	-490	40	-186	-920
6 个月期限	-985	-1122	-1120	21	-409	-1920
1 年期限	-2165	-2406	-2330	130	-735	-3824

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	7.2977	7.0950	7.2060	363	8301	-376
2 个月期限	7.3050	7.1030	7.2100	365	8186	-160
3 个月期限	7.3070	7.1055	7.2090	345	8046	15
6 个月期限	7.2771	7.0750	7.1720	323	7271	275
1 年期限	7.2234	7.0055	7.0980	288	5811	745

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。