

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年8月8日-8月12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12日）报6.7413，较前周贬值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.30%，上周最高6.7230、最低6.7653，收于6.7430，波幅为0.63%。上周受7月出口维持高增长、美国通胀数据低于市场预期等因素影响，人民币对美元汇率震荡升值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国宏观经济基本面持续好转、美联储激进加息预期减弱等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.7100-6.7800区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行，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85个点，上周最高-825、最低-882，收于-845，波幅为6.75%。
- 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）较前周下行385个点，上周最高6.7154、最低6.6405，收于6.6675，波幅为1.12%。

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	-	-	6.7413	8	-24	3656
银行间市场汇价	6.7230	6.7653	6.7430	-200	40	3700
掉期点						
1 个月期限	-66.85	-78	-74	-5	-15	-263
2 个月期限	-119	-164	-154	-4	-29	-450
3 个月期限	-236	-261	-241	-13	-64	-671
6 个月期限	-485	-537	-504	-26	-142	-1304
1 年期限	-825	-882	-845	-85	-275	-2339

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	6.7610	6.7034	6.7295	-218	3536	-61
2 个月期限	6.7579	6.6995	6.7240	-265	3326	-36
3 个月期限	6.7529	6.6930	6.7185	-256	3141	-4
6 个月期限	6.7369	6.6693	6.6970	-312	2521	44
1 年期限	6.7154	6.6405	6.6675	-385	1506	90

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。