

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年8月29日-9月2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2日）报6.8917，较前周贬值约0.63%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.59%，上周最高6.8850、最低6.9230，收于6.9028，波幅为0.55%。上周受美元指数持续走高、国内监管层频繁释放积极信号等因素影响，人民币对美元汇率震荡贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济保持修复势头、欧元区经济基本面不佳、美联储或采取激进加息策略等因素共同影响，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，各期限掉期点区间震荡，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54个点，上周最高-1080、最低-1145，收于-1126，波幅为5.77%。
- 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265个点，上周最高6.8632、最低6.7803，收于6.8330，波幅为1.21%。

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	-	-	6.8917	431	11	5160
银行间市场汇价	6.9230	6.885	6.9028	407	123	5298
掉期点						
1 个月期限	-54	-83	-63	1	10	-252
2 个月期限	-136	-153	-142	10	-1	-438
3 个月期限	-228	-255	-240	10	1	-670
6 个月期限	-514	-555	-535	-5	-10	-1335
1 年期限	-1080	-1145	-1126	-54	-16	-2620

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	6.9258	6.8541	6.9010	195	5251	45
2 个月期限	6.9271	6.8501	6.9025	245	5111	139
3 个月期限	6.9211	6.8441	6.8980	255	4936	192
6 个月期限	6.9004	6.8370	6.8790	300	4341	297
1 年期限	6.8632	6.7803	6.8330	265	3161	428

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。