

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年9月5日-9月9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9日）报6.9098，较前周贬值约0.26%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.39%，上周最高6.9150、最低6.9808，收于6.9299，波幅为0.95%。上周受人民银行宣布下调金融机构外汇存款准备金率、欧央行大幅加息施压美元指数等因素影响，人民币对美元汇率先贬后升、整体小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济基本面韧性强、监管维持汇率稳定态度明确、欧元汇率低位反弹、美联储释放持续加息信号等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.8900-6.9800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上行51个点，上周最高-1040、最低-1188，收于-1075，波幅为13.77%。
- 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234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 6.9235、最低 6.8261，收于 6.8564，波幅为 1.42%。

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	-	-	6.9098	181	192	5341
银行间市场汇价	6.9808	6.9150	6.9299	271	394	5569
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	-52	-76	-58	5	15	-247
2 个月期限	-79	-152	-146	-4	-5	-442
3 个月期限	-216	-254	-244	-4	-3	-674
6 个月期限	-275	-559	-518	17	7	-1318
1 年期限	-1040	-1188	-1075	51	35	-2569

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	6.9735	6.8935	6.9151	141	5392	-90
2 个月期限	6.9780	6.8940	6.9187	162	5273	34
3 个月期限	6.9770	6.8895	6.9169	189	5125	114
6 个月期限	6.9565	6.8690	6.8981	191	4532	200
1 年期限	6.9235	6.8261	6.8564	234	3395	340

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。