工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2022 年 9 月 13 日-9 月 16 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 16 日）报 6.9305，较前周贬值约 0.30%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 1.24%，上周最高 6.9150、最低 7.0268，收于 7.0166，波幅为 1.59%。上周受国内疫情继续发酵、8 月银行结售汇和涉外收支均为顺差、美国通胀高企提振美联储大幅加息预期等因素影响，人民币对美元汇率明显贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济延续恢复发展态势、央行积极推进金融市场双向开放、美联储加息预期等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.9800-7.0700 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 315 个点，上周最高-1068、最低-1401，收于-1390，波幅为 23.96%。
- 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 574 个点，上周最高 6.9495、最低 6.8256，收于 6.9138，波幅为 1.79%。

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	-	-	6.9305	207	399	5548
银行间市场汇价	7.0268	6.9150	7.0166	867	1261	6436
掉期点						
1 个月期限	-48	-65	-61	-3	12	-250
2 个月期限	-134	-165	-158	-12	-17	-454
3 个月期限	-234	-273	-269	-25	-28	-699
6 个月期限	-515	-648	-592	-74	-67	-1392
1 年期限	-1068	-1401	-1390	-315	-280	-2884

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	7.0045	6.8859	6.9707	556	5948	-398
2 个月期限	7.0105	6.8876	6.9764	577	5850	-244
3 个月期限	7.0115	6.8821	6.9760	591	5716	-137
6 个月期限	6.9915	6.8666	6.9579	598	5130	5
1 年期限	6.9495	6.8256	6.9138	574	3969	362

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。