

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年10月31日-11月4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（11月4日）报7.2555，较前周贬值约1.18%。银行间外汇市场人民币汇率较前周贬值约0.19%，上周最高7.1700、最低7.3280，收于7.2703，波幅为2.17%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期掉期点较前周下行115个点，上周最高-2360、最低-2510，收于-2445，波幅为6.13%。
- 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1085个点，上周最高7.1750、最低6.9710，收于6.9895，波幅为2.92%。

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	-	-	7.2555	857	787	8798
银行间市场汇价	7.3280	7.1700	7.2703	138	-282	8973
掉期点						
1 个月期限	-38	-139	-129	0	-4	-318
2 个月期限	-293	-330	-315	-10	-4	-611
3 个月期限	-485	-527	-510	-20	-5	-940
6 个月期限	-985	-1122	-1120	0	30	-1920
1 年期限	-2360	-2510	-2445	-115	-15	-3939

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	7.2845	7.1065	7.1325	-735	7566	-1249
2 个月期限	7.2895	7.1060	7.1285	-815	7371	-1103
3 个月期限	7.2895	7.1060	7.1265	-825	7221	-928
6 个月期限	7.2510	7.0650	7.0855	-865	6406	-728
1 年期限	7.1750	6.9710	6.9895	-1085	4726	-363

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。