

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年12月12日-12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（12月16日）报6.9791，较前周贬值约0.29%。银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.31%，上周最高6.9365、最低6.9905，收于6.9716，波幅为0.77%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期掉期点较前周上行89个点，上周最高-1908、最低-2045，收于-1930，波幅为7.10%。
- 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120个点，上周最高6.8460、最低6.7651，收于6.8190，波幅为1.19%。

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	—	—	6.9791	203	-1978	6034
银行间市场汇价	6.9905	6.9365	6.9716	236	-1703	5986
掉期点						
1 个月期限	-159	-194	-167	9	6	-356
2 个月期限	-340	-370	-344	7	21	-640
3 个月期限	-498	-545	-500	28	45	-930
6 个月期限	-1002	-1093	-1015	62	100	-1815
1 年期限	-1908	-2045	-1930	89	159	-3426

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	6.9105	6.9510	80	5751	-39.5
2 个月期限	6.9595	6.8951	6.9375	85	5461	3
3 个月期限	6.9467	6.8821	6.9255	110	5211	-117
6 个月期限	6.9479	6.8368	6.8840	110	4391	-376
1 年期限	6.8460	6.7651	6.8190	120	3021	405

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。