

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022 年 12 月 19 日-12 月 23 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 23 日）报 6.9810，较前周贬值约 0.03%。银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.22%，上周最高 6.9604、最低 6.9990，收于 6.9870，波幅为 0.55%。
- 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 10 个点，上周最高-1880、最低-1969，收于-1920，波幅为 4.64%。
- 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 167 个点，上周最高 6.8508、最低 6.7767，收于 6.8392，波幅为 1.08%。

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	—	—	6.9810	19	-1959	6053
银行间市场汇价	6.9990	6.9604	6.9870	154	-1549	6140
掉期点						
1 个月期限	-159	-205	-164	3	8	-353
2 个月期限	-313	-340	-313.01	31	52	-609
3 个月期限	-470	-500	-482	18	63	-912
6 个月期限	-979	-1032	-1013	2	102	-1813
1 年期限	-1880	-1969	-1920	10	200	-3414

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	6.9911	6.9204	6.9760	245	6001	-464
2 个月期限	6.9753	6.9078	6.9647	257	5733	-358
3 个月期限	6.9623	6.8951	6.9522	232	5478	-241
6 个月期限	6.9178	6.8457	6.9057	192	4608	-71
1 年期限	6.8508	6.7767	6.8392	167	3223	131

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。