

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、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) |
|-----------------------|--------|--------|--------|------------|-------------|-------------|
| 即期汇率 | | | | | | |
| 中间价 | - | - | 6.9098 | 181 | 192 | 5341 |
| 银行间市场汇价 | 6.9808 | 6.9150 | 6.9299 | 271 | 394 | 5569 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 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 | | | | | | |
| 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。