

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年10月10日-10月14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（10月14日）报7.1088，较9月30日贬值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月30日贬值约1.39%，上周最高价7.2251、最低价7.1000，收于7.1931，波幅为1.74%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较9月30日下行545个点，上周最高价-1668、最低价-2145，收于-2140，波幅为22.29%。
- 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240个点，上周最高价7.0860、最低价6.9894，收于7.0590，波幅为1.37%。

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9月 30日 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	-	-	7.1088	90	90	7331
银行间市场汇价	7.2251	7.1000	7.1931	1000	1000	8201
掉期点						
1个月期限	-15.20	-141.70	-138	-49	-49	-327
2个月期限	-219	-299	-299	-107	-107	-595
3个月期限	-154	-490	-472	-168	-168	-902
6个月期限	-770	-1070	-1067	-357	-357	-1867
1年期限	-1668	-2145	-2140	-545	-545	-3634

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	7.1720	7.0614	7.1490	480	7731	-303
2个月期限	7.1751	7.0603	7.1515	455	7601	-117
3个月期限	7.1741	7.0598	7.1510	460	7466	50
6个月期限	7.1470	7.0363	7.1220	400	6771	356
1年期限	7.0860	6.9894	7.0590	240	5421	799

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。