

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年6月20日-6月24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（6月24日）报6.7000，较前周贬值约0.11%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.11%，上周最高6.6730、最低6.7278，收于6.6936，波幅为0.82%。上周受国内股市持续回暖、美国考虑取消部分对华加征关税、美元指数小幅回调等因素影响，人民币对美元汇率小幅升值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济呈现明显复苏势头、市场乐观预期提升、季节性购汇需求逐渐累积等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.6600-6.7300区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，掉期点横盘震荡，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60个点，上周最高-115、最低-429，收于-310，波幅为101.29%。
- 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7个点，上周最高6.7255、最低6.6464，收于6.6737，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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.7000	77	393	3243
银行间市场汇价	6.7278	6.6730	6.6936	-74	358	3206
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	15.50	4.85	6.30	-7.70	-44.70	-182.70
2 个月期限	9.50	-3.50	0	-1.90	-71	-296
3 个月期限	2	-17	-11	-1	-91	-441
6 个月期限	-32	-139	-105	0	-186	-905
1 年期限	-115	-429	-310	60	-325	-1804

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	6.7534	6.6666	6.6867	-111	3108	-75
2 个月期限	6.7421	6.6692	6.6897	-154	2983	-39
3 个月期限	6.7400	6.6731	6.6917	-107	2873	-8
6 个月期限	6.7385	6.6670	6.6862	-34	2413	31
1 年期限	6.7255	6.6464	6.6737	7	1568	111

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。