

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年7月4日-7月8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（7月8日）报6.7098，较前周贬值约0.35%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.07%，上周最高6.7230、最低6.6842，收于6.7051，波幅为0.58%。上周受中美高层会晤、市场担忧欧美经济衰退等因素影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受美元指数保持强势、季节性购汇需求持续涌现、中美经贸关系出现缓和信号等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.6700-6.7300区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡下行，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下行106个点，上周最高-170、最低-430，收于-366，波幅为71.04%。
- 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）较前周下行243个点，上周最高6.7172、最低6.6477，收于6.6619，波幅为1.04%。

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	-	-	6.7098	235	-16	3341
银行间市场汇价	6.7230	6.6842	6.7051	45	108	3321
掉期点						
1个月期限	11	-18	-15	-23	-21	-204
2个月期限	3	-55	-45	-44	-38	-341
3个月期限	-6	-81	-74	-57	-53	-504
6个月期限	0	-220	-206	-104	-94	-1006
1年期限	-170	-430	-366	-106	-51	-1860

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	6.7215	6.6744	6.6809	-176	3050	-227
2个月期限	6.7231	6.6731	6.6809	-178	2895	-197
3个月期限	6.7245	6.6741	6.6824	-196	2780	-153
6个月期限	6.7190	6.6653	6.6749	-202	2300	-96
1年期限	6.7172	6.6477	6.6619	-243	1450	-66

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。