

# 工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2022年7月11日-7月15日)

## ◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（7月15日）报6.7503，较上周贬值约0.60%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周贬值约0.80%，本周最高6.6964、最低6.7700，收于6.7593，波幅1.09%。本周境内人民币汇率震荡贬值，主要受美元多头仓位增加、美元指数创近二十年新高、我国上半年出口数据保持快速增长等因素影响。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点震荡下行，截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周下行219个点，本周最高-189、最低-586，收于-585，波幅67.86%。
- 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）较上周上行651个点，本周最高6.7493、最低6.6638，收于6.7270，波幅1.27%。

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	较上周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.7503	405	389	3746
银行间市场汇价	6.6964	6.7700	6.7593	542	650	3863
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	-10	-36	-32	-17	-38	-221
2 个月期限	-48	-85	-82	-37	-75	-378
3 个月期限	-76	-149	-149	-75	-128	-579
6 个月期限	-183	-345	-340	-134	-228	-1140
1 年期限	-189	-586	-585	-219	-270	-2079

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	6.7865	6.6818	6.7519	710	3760	-42
2 个月期限	6.7845	6.6818	6.7523	714	3609	12
3 个月期限	6.7825	6.6828	6.7519	695	3475	75
6 个月期限	6.7700	6.6758	6.7427	678	2978	174
1 年期限	6.7493	6.6638	6.7270	651	2101	262

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。