工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2022 年 7 月 18 日-7 月 22 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 22 日）报 6.7522，较前周贬值约 0.03%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.09%，上周最高 6.7723、最低 6.7317，收于 6.7518，波幅为 0.60%。上周受欧央行加息幅度高于市场预期、上半年我国银行结售汇保持顺差等因素影响，人民币对美元汇率小幅升值。预计人民币汇率宽幅震荡，受市场预期美联储本月将大概率大幅加息、意大利政局动荡等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.7200-6.6800 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 70 个点，上周最高-545、最低-681，收于-655，波幅为 20.76%。
- 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 109 个点，上周最高 6.7480、最低 6.6815，收于 6.7161，波幅为 0.99%。

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	-	-	6.7522	19	408	3765
银行间市场汇价	6.7723	6.7317	6.7518	-62	575	3788
掉期点						
1 个月期限	-30	-52	-47	-14	-53	-236
2 个月期限	-82	-100	-100	-18	-93	-396
3 个月期限	-139	-164	-161	-12	-140	-591
6 个月期限	-333	-390	-374	-374	-262	-1174
1 年期限	639	-681	-655	-70	-340	-2149

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	6.7807	6.7233	6.7548	29	3789	77
2 个月期限	6.7794	6.7219	6.7536	13	3622	118
3 个月期限	6.7763	6.7220	6.7503	-16	3459	85
6 个月期限	6.7652	6.7040	6.7368	-59	2919	11
1 年期限	6.7480	6.6815	6.7161	-109	1992	298

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。