

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年7月25日-7月29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29日）报6.7437，较前周升值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.40%，上周最高6.7175、最低6.7693，收于6.7390，波幅为0.77%。上周受我国经济基本面相对稳定、美国二季度实际GDP环比下降、美联储如预期加息75BP但表态偏鸽等因素共同影响，人民币对美元汇率震荡升值。预计人民币汇率宽幅震荡，受美欧经济数据显示衰退风险上升、美元债券收益率面临高位回调压力、我国经济活动逐渐走上正轨等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.6800~6.7600区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，掉期点区间震荡，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85个点，上周最高-560、最低-690，收于-570，波幅为22.81%。
- 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356个点，上周最

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。

高价 6.7309、最低价 6.6741，收于 6.6805，波幅为 0.85%。

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	-	-	6.7437	-85	323	3680
银行间市场汇价	6.7693	6.7175	6.7390	-267	447	3660
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	-45	-63	-59	-12.50	-65	-248
2 个月期限	-98.50	-130	-125	-25	-118	-421
3 个月期限	-159.31	-191	-177	-16.50	-156	-607
6 个月期限	-343	-405	-362	12	-250	-1162
1 年期限	-560	-690	-570	85	-255	-2064

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	6.7705	6.7150	6.7425	-123	3666	94
2 个月期限	6.7690	6.7138	6.7416	-120	3502	151
3 个月期限	6.7655	6.7084	6.7386	-117	3342	173
6 个月期限	6.7522	6.6915	6.7251	-117	2802	223
1 年期限	6.7309	6.6741	6.6805	-356	1636	-15

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。