

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年8月1日-8月5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（8月5日）报6.7405，较前周升值约0.05%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.35%，上周最高6.7835、最低6.7405，收于6.7630，波幅为0.64%。上周受上半年我国服务贸易保持较快增长、市场避险情绪攀升等因素共同影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受地缘政治风险攀升、市场关注我国7月贸易数据及美国通胀等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.7000-6.7800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190个点，上周最高0、最低-790，收于-760，波幅为103.95%。
- 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255个点，上周最高6.7510、最低6.6791，收于6.7060，波幅为1.07%。

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	-	-	6.7405	-32	-32	3648
银行间市场汇价	6.7835	6.7405	6.7630	240	240	3900
<b>掉期点</b>						
1个月期限	77	-230	-70	-11	-11	-259
2个月期限	0	-158	-150	-25	-25	-446
3个月期限	-58	-248	-228	-51	-51	-658
6个月期限	-388	-491	-478	-116	-116	-1278
1年期限	0	-790	-760	-190	-190	-2254

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	6.7231	6.7513	88	3754	-48
2个月期限	6.7840	6.7266	6.7505	89	3591	25
3个月期限	6.7805	6.7198	6.7441	55	3397	39
6个月期限	6.7665	6.6987	6.7282	31	2833	130
1年期限	6.7510	6.6791	6.7060	255	1891	190

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。