

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年5月30日-6月2日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周四（6月2日）报6.7095，较前周升值约0.44%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.50%，上周最高6.6445、最低6.7070，收于6.6750，波幅为0.94%。上周受国内股市有所回暖、美国考虑取消部分对华加征关税等因素影响，人民币对美元汇率震荡升值。预计人民币汇率宽幅震荡，受国内稳增长政策持续发力、美元指数高位震荡等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.6500-6.7200区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点震荡上行，截至上周四16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行27个点，上周最高60、最低2，收于14，波幅为414.29%。
- 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1259个点，上周最高6.7460、最低6.6247，收于6.6806，波幅为1.82%。

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	-	-	6.7095	-292	488	3338
银行间市场汇价	6.6445	6.7070	6.6750	-331	172	3020
掉期点						
1 个月期限	71	0	49	7	-2	-140
2 个月期限	81	22	72	7	1	-224
3 个月期限	91	75	82	15	2	-348
6 个月期限	96	71	73	13	-8	-727
1 年期限	60	2	14	27	-1	-1480

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	6.7231	6.6064	6.6529	-1231	2770	-270
2 个月期限	6.7336	6.6128	6.6614	-1244	2700	-208
3 个月期限	6.7323	6.6207	6.6679	-1286	2635	-153
6 个月期限	6.7400	6.6187	6.6764	-1306	2315	-59
1 年期限	6.7460	6.6247	6.6806	-1259	1637	42

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。