工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

（2022 年 6 月 27 日-7 月 1 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 1 日）报 6.6863，较前周升值约 0.20%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.10%，上周最高 6.6735、最低 6.7175，收于 6.7006，波幅为 0.66%。上周受我国 6 月制造业数据回升、美元指数保持强势等因素影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受我国经济复苏势头向好、市场保持乐观情绪、季节性购汇需求增加等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.6700-6.7300 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 50 个点，上周最高-260、最低-355，收于-260，波幅为 36.54%。
- 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 125 个点，上周最高 6.7160、最低 6.6500，收于 6.6862，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	-	-	6.6863	-137	-251	3106
银行间市场汇价	6.7175	6.6735	6.7006	70	63	3276
掉期点						
1 个月期限	9	1	8	-8	2	-181
2 个月期限	3	-9	-1	-1	6	-297
3 个月期限	-7	-28	-17	-6	4	-447
6 个月期限	-93	-130	-102	3	10	-902
1 年期限	-260	-355	-260	50	55	-1754

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	6.7419	6.6640	6.6985	118	3226	-29
2 个月期限	6.7463	6.6665	6.6987	90	3073	-18
3 个月期限	6.7341	6.6680	6.7020	103	2976	31
6 个月期限	6.7270	6.6613	6.6951	89	2502	47
1 年期限	6.7160	6.6500	6.6862	125	1693	116

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。