

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022 年 5 月 23 日-5 月 27 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（5 月 27 日）报 6.7387，较前周升值约 0.15%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.51%，上周最高 6.6441、最低 6.7600，收于 6.7081，波幅为 1.73%。上周受国内疫情扰动复工复产、市场避险情绪升温等因素影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率宽幅震荡，受美联储连续加息的不确定性增加、国内疫情防控持续推进等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.6500-6.7800 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 8 个点，上周最高 43、最低-23，收于 -13，波幅为 507.69%。
- 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 87 个点，上周最高 6.8065、最低 6.6591，收于 6.7147，波幅为 2.20%。

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	-	-	6.7387	-100	1210	3630
银行间市场汇价	6.7600	6.6441	6.7081	341	1215	3351
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	55	26.40	42	-7	-35	-147
2 个月期限	78	60	65	-11	-57	-231
3 个月期限	95	65	67	-16	-107	-363
6 个月期限	95.50	60	60	-25	-238	-740
1 年期限	43	-23	-13	-8	-408	-1507

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	6.7760	6.6374	6.7105	181	3346	-18
2 个月期限	6.7858	6.6451	6.7200	161	3286	54
3 个月期限	6.7965	6.6541	6.7275	151	3231	127
6 个月期限	6.8070	6.6598	6.7370	216	2921	229
1 年期限	6.8065	6.6591	6.7147	-87	1978	79

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。