

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年5月5日-5月6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6日）报6.6332，较前周贬值约0.23%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.46%，上周最高6.5700、最低6.6982，收于6.6845，波幅为1.92%。上周受美联储如期加息并宣布缩表进程、美元指数强势上涨、俄乌冲突持续等因素影响，人民币对美元汇率震荡贬值。预计人民币汇率面临一定贬值压力，受中美十年期国债利差倒挂程度加深、市场避险情绪浓厚、中国经济韧性较强等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.6700-6.7400区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点有所下行，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200个点，上周最高383、最低180，收于195，波幅为51.39%。
- 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450个点，上周最高6.7964、最低6.6696，收于6.7668，波幅为1.87%。

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	-	-	6.6332	155	155	2575
银行间市场汇价	6.6982	6.5700	6.6845	979	979	3115
掉期点						
1 个月期限	71	58	59	-18	-18	-130
2 个月期限	130	103	103	-19	-19	-193
3 个月期限	177.50	133	135	-39	-39	-295
6 个月期限	294	167.04	167.04	-130.96	-130.96	-632.96
1 年期限	383	180	195	-200	-200	-1299

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	6.7255	6.5945	6.7068	720	3309	164
2 个月期限	6.7404	6.6079	6.7228	710	3314	280
3 个月期限	6.7534	6.6214	6.7363	705	3319	383
6 个月期限	6.7889	6.6450	6.7538	630	3089	526
1 年期限	6.7964	6.6696	6.7668	450	2499	628

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。