

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年1月17日-1月21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（1月21日）报6.3492，较前周升值约0.29%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.06%，上周最高6.3365、最低6.3590，收于6.3397，波幅0.35%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受中国经济稳中向好等因素影响。预计本周人民币汇率高位震荡，主要受近期美债收益率高位震荡、银行结售汇市场偏向顺差等因素影响，人民币汇率将在6.3300-6.3600区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点整体下行，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109个点，上周最高1250、最低1160，收于1181，波幅6.98%。
- 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312个点，上周最高6.5013、最低6.4434，收于6.4622，波幅0.90%。

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	—	—	6.3492	-185	-265	-265
银行间市场汇价	6.3365	6.3590	6.3397	-38	-333	-333
掉期点						
1 个月期限	141.75	52	135	-3	-54	-54
2 个月期限	249	98	238	-20.50	-58	-58
3 个月期限	360	333	351	-19	-79	-79
6 个月期限	660	628	646	-34	-154	-154
1 年期限	1250	1160	1181	-109	-313	-313

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	6.3901	6.3444	6.3532	-172	-227	0
2 个月期限	6.4035	6.3534	6.3641	-198	-273	6
3 个月期限	6.4174	6.3659	6.3772	-197	-272	24
6 个月期限	6.4566	6.3941	6.4076	-248	-373	33
1 年期限	6.5013	6.4434	6.4622	-312	-547	44

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。