

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2022年1月24日-1月28日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（1月28日）报6.3746，较上周贬值约0.40%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周贬值约0.38%，本周最高6.3200、最低6.3699，收于6.3636，波幅0.78%。本周境内人民币汇率震荡贬值，主要受美联储议息会议表态偏鹰提振美元指数等因素影响。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点区间震荡，截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周下行35个点，本周最高1220、最低1105，收于1146，波幅9.74%。
- 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）较上周上行241个点，本周最高6.4957、最低6.4201，收于6.4863，波幅1.17%。

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	较上周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.3746	254	-11	-11
银行间市场汇价	6.3200	6.3699	6.3636	239	-94	-94
掉期点						
1 个月期限	172	77	121	-14	-68	-68
2 个月期限	286.24	221	240	2	-56	-56
3 个月期限	445	335	350	-1	-80	-80
6 个月期限	832	616	647	1	-153	-153
1 年期限	1220	1105	1146	-35	-348	-348

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	6.3961	6.3256	6.3819	287	60	62
2 个月期限	6.4090	6.3330	6.3958	317	44	82
3 个月期限	6.4253	6.3451	6.4072	300	28	86
6 个月期限	6.4590	6.3708	6.4388	312	-61	105
1 年期限	6.4957	6.4201	6.4863	241	-306	81

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。