

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年3月14日-3月18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（3月18日）报 6.3425，较前周贬值约 0.19%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.65%，上周最高 6.3360、最低 6.3880，收于 6.3641，波幅 0.82%。上周境内人民币汇率有所贬值，主要受俄乌谈判未取得明显进展、美联储如期加息 25BP 等因素影响。预计本周人民币汇率交投区间将主要集中在 6.3400-6.3800。
- 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 75 个点，上周最高 1042、最低 980，收于 985，波幅 5.85%。
- 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 7 个点，上周最高 6.5309、最低 6.4497，收于 6.4746，波幅 1.25%。

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	—	—	6.3425	119	-321	-332
银行间市场汇价	6.3880	6.3360	6.3641	413	5	-89
掉期点						
1 个月期限	145	133	140	5	-19	-49
2 个月期限	255	245	256	0	-19	-40
3 个月期限	397	324	360	-10	-13	-70
6 个月期限	630	589	610	-12	-40	-190
1 年期限	1042	980	985	-75	-90	-509

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	6.4249	6.3551	6.3776	58	17	-5
2 个月期限	6.4390	6.3696	6.3931	78	17	34
3 个月期限	6.4500	6.3821	6.4046	78	2	45
6 个月期限	6.4790	6.4089	6.4336	63	-113	85
1 年期限	6.5309	6.4497	6.4746	-7	-423	120

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。