

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年3月21日-3月25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25日）报6.3739，较前周贬值约0.49%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.02%，上周最高6.3510、最低6.3780，收于6.3655，波幅0.42%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受俄乌冲突持续、美元流动性趋紧等因素影响。预计本周人民币汇率交投区间将主要集中在6.3500-6.4000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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125个点，上周最高977、最低857，收于860，波幅12.18%。
- 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15个点，上周最高6.4937、最低6.4485，收于6.4761，波幅0.70%。

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	—	—	6.3739	314	-7	-18
银行间市场汇价	6.3510	6.3780	6.3655	14	19	-75
掉期点						
1 个月期限	144	125	132	-8	-27	-57
2 个月期限	256	238	252	-4	-23	-44
3 个月期限	358	330	336	-24	-37	-94
6 个月期限	607	542	610	0	-40	-190
1 年期限	977	857	860	-125	-215	-634

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	6.4063	6.3637	6.3926	150	167	139
2 个月期限	6.4213	6.3763	6.4081	150	167	174
3 个月期限	6.4354	6.3902	6.4181	135	137	190
6 个月期限	6.4734	6.4105	6.4421	85	-28	156
1 年期限	6.4937	6.4485	6.4761	15	-408	246

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。