

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年4月6日-4月8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（4月8日）报6.3653，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0.07%，上周最高6.3560、最低6.3775，收于6.3637，波幅为0.34%。上周受美元指数高位震荡、市场供需相对均衡等因素共同影响，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，受美联储官员发表鹰派言论、结售汇市场供求较为均衡等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3500-6.4100区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行，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96个点，上周最高700、最低652，收于660，波幅为6.35%。
- 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71个点，上周最高6.4651、最低6.4186，收于6.4431，波幅为0.72%。

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	—	—	6.3653	144	171	-104
银行间市场汇价	6.3560	6.3775	6.3637	46	204	-93
掉期点						
1 个月期限	128	114	117	-2	-3	-72
2 个月期限	221	214	214	-3	-14	-82
3 个月期限	363	295	295.50	-15.50	-21.50	-134.50
6 个月期限	510	479	482	-43	-65	-318
1 年期限	700	652	660	-96	-136	-834

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	6.4053	6.3564	6.3746	-6	-13	-8
2 个月期限	6.4167	6.3704	6.3891	4	-23	40
3 个月期限	6.4324	6.3814	6.3982	-20	-62	49.5
6 个月期限	6.4561	6.3957	6.4221	-11	-228	102
1 年期限	6.4651	6.4186	6.4431	-71	-738	134

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。