

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年4月11日-4月15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15日）报6.3896，较前周贬值约0.38%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.12%，上周最高6.3623、最低6.3815，收于6.3712，波幅为0.30%。上周受美元指数保持强势、中美国债利差形成倒挂、3月中国贸易顺差保持高位等因素共同影响，人民币对美元汇率震荡贬值。预计人民币汇率区间波动，受美元指数高位盘整、银行间交易商预期分化等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3600-6.4100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20个点，上周最高690、最低613，收于640，波幅为11.59%。
- 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148个点，上周最高6.4753、最低6.4349，收于6.4579，波幅为0.63%。

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	-	-	6.3896	243	414	139
银行间市场汇价	6.3815	6.3623	6.3712	75	279	-18
掉期点						
1 个月期限	122	105.4	106	-11	-14	-83
2 个月期限	217	201.7	204	-10	-24	-92
3 个月期限	296.5	268	272	-23.5	-45	-158
6 个月期限	495	444	446	-36	-101	-354
1 年期限	690	613	640	-20	-156	-854

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	6.4064	6.3696	6.3879	133	120	61
2 个月期限	6.4193	6.3831	6.4014	123	100	98
3 个月期限	6.4356	6.3946	6.4124	142	80	140
6 个月期限	6.4733	6.4134	6.4359	138	-90	201
1 年期限	6.4753	6.4349	6.4579	148	-590	227

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。