

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年4月18日-4月22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22日）报6.4596，较前周贬值约1.08%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约2.01%，上周最高6.3643、最低6.5068，收于6.5016，波幅为2.19%。上周受美联储主席鲍威尔发表鹰派言论、市场避险情绪升温等因素影响，人民币对美元汇率明显贬值。预计人民币汇率低位区间波动，受近期客户购汇意愿上升、市场预期总体稳定等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.5000-6.6000区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，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100个点，上周最高637、最低518，收于540，波幅为18.59%。
- 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1249个点，上周最高6.6212、最低6.4351，收于6.5828，波幅为2.83%。

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	-	-	6.4596	700	1114	839
银行间市场汇价	6.5068	6.3643	6.5016	1304	1583	1286
掉期点						
1 个月期限	115	90	94	-12	-26	-95
2 个月期限	197	178	182	-22	-46	-114
3 个月期限	278	246	253	-19	-64	-177
6 个月期限	458	408	408	-38	-139	-392
1 年期限	637	518	540	-100	-256	-954

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	6.5475	6.3707	6.5289	1410	1530	179
2 个月期限	6.5633	6.3845	6.5449	1435	1535	251
3 个月期限	6.5743	6.3960	6.5559	1435	1515	290
6 个月期限	6.5983	6.4152	6.5635	1276	1186	211
1 年期限	6.6212	6.4351	6.5828	1249	659	272

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。