

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年5月9日-5月13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（5月13日）报6.7898，较前周贬值约2.31%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约1.45%，上周最高6.6895、最低6.8150，收于6.7830，波幅为1.85%。上周受美元指数走强、市场避险情绪抬升、国内部分经济数据走弱等因素影响，人民币对美元汇率继续贬值。本周受美联储加息预期进一步升温、客盘逢高结汇有所增加、银行间市场预期平稳等因素影响，预计人民币汇率宽幅震荡，在岸人民币对美元汇率将在6.7500-6.8300区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，各期限掉期点有所下行，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205个点，上周最高120、最低-70，收于-10，波幅为97.44%。
- 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542个点，上周最高6.8665、最低6.7312，收于6.8210，波幅为1.98%。

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	-	-	6.7898	1566	1721	4141
银行间市场汇价	6.8150	6.6895	6.7830	985	1964	4100
掉期点						
1 个月期限	52	34	43.50	-15.50	-33.50	-145.50
2 个月期限	80	55	77	-26	-45	-219
3 个月期限	116	66	77	-58	-97	-353
6 个月期限	101	-40	67	-100.04	-231	-733
1 年期限	120	-70	-10	-205	-405	-1504

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	6.8390	6.6923	6.7860	792	4101	-14
2 个月期限	6.8519	6.7033	6.8000	772	4086	93
3 个月期限	6.8689	6.7168	6.8095	732	4051	188
6 个月期限	6.8580	6.7295	6.8170	632	3721	273
1 年期限	6.8665	6.7312	6.8210	542	3041	390

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。