

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年2月7日-2月11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（2月11日）报6.3681，较前周升值约0.10%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.07%，上周最高6.3525、最低6.3718，收于6.3592，波幅为0.30%。上周受外汇局表示直接投资净流入增长显著、美联储加息预期升温推升美元指数等因素共同影响，人民币对美元汇率小幅震荡。预计人民币汇率宽幅震荡，受市场预期美联储将加快收紧货币政策、客户逢高结汇等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3450-6.3850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173个点，上周最高1106、最低958，收于973，波幅为12.91%。
- 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290个点，上周最高6.4884、最低6.4427，收于6.4573，波幅为0.71%。

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	—	—	6.3681	-65	-65	-76
银行间市场汇价	6.3525	6.3718	6.3592	-44	-44	-138
掉期点						
1 个月期限	130	105	122	1	1	-67
2 个月期限	255	223	225	-15	-15	-71
3 个月期限	365	318	332	-18	-18	-98
6 个月期限	651	566	580	-67	-67	-220
1 年期限	1106	958	973	-173	-173	-521

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	6.3959	6.3535	6.3728	-91	-31	14
2 个月期限	6.4130	6.3650	6.3863	-95	-51	46
3 个月期限	6.4241	6.3777	6.3988	-84	-56	64
6 个月期限	6.4566	6.4026	6.4248	-140	-201	76
1 年期限	6.4884	6.4427	6.4573	-290	-596	8

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。