

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年2月14日-2月18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18日）报6.3343，较前周升值约0.53%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.52%，上周最高6.3247、最低6.3632，收于6.3265，波幅0.61%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受境外机构增持人民币资产、人民币全球支付占比升至历史新高、美联储会议纪要未提供额外加息信号等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡走势，主要受俄乌地缘政治风险暂未消解、结售汇市场偏向结汇等因素影响，人民币汇率将在6.3200-6.3550区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点整体上行，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上行67个点，上周最高1065、最低965，收于1040，波幅10.28%。
- 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288个点，上周最高6.4795、最低6.4151，收于6.4311，波幅1.00%。

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	—	—	6.3343	-338	-403	-414
银行间市场汇价	6.3632	6.3247	6.3265	-327	-371	-465
掉期点						
1 个月期限	136	121	133	11	12	-56
2 个月期限	258	0	251	26	11	-45
3 个月期限	367	101	360	28	10	-70
6 个月期限	636	581	623	43	-24	-177
1 年期限	1065	965	1040	67	-106	-454

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	6.3919	6.3245	6.3391	-373	-368	-7
2 个月期限	6.4048	6.3385	6.3502	-397	-412	-14
3 个月期限	6.4208	6.3500	6.3660	-364	-384	35
6 个月期限	6.4532	6.3756	6.3914	-385	-535	26
1 年期限	6.4795	6.4151	6.4311	-288	-858	6

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。