

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年2月21日-2月25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25日）报6.3346，与前周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.19%，上周最高6.3100、最低6.3453，收于6.3142，波幅0.56%。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等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持宽幅区间震荡走势，主要受俄乌局势恶化、结售汇市场略偏结汇、美联储激进加息市场预期降温等因素共同影响，人民币汇率将在6.3000-6.3550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33个点，上周最高1105、最低1017，收于1073，波幅8.46%。
- 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184个点，上周最高6.4685、最低6.4075，收于6.4127，波幅0.95%。

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	—	—	6.3346	3	-400	-411
银行间市场汇价	6.3453	6.3100	6.3142	-123	-494	-588
掉期点						
1 个月期限	153.02	97	138.5	5.5	17.5	-50.5
2 个月期限	283	32	273	22	33	-23
3 个月期限	390	349	369	9	19	-61
6 个月期限	668	616	645	22	-2	-155
1 年期限	1105	1017	1073	33	-73	-421

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	6.3758	6.3141	6.3173	-218	-586	-107
2 个月期限	6.3887	6.3281	6.3292	-210	-622	-123
3 个月期限	6.4026	6.3406	6.3418	-242	-626	-93
6 个月期限	6.4448	6.3702	6.3721	-193	-728	-66
1 年期限	6.4685	6.4075	6.4127	-184	-1042	-88

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。