

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年2月28日-3月4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（3月4日）报6.3288，较前周升值约0.09%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.07%，上周最高6.3048、最低6.3240，收于6.3189，波幅0.30%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受境外机构增持人民币资产、美联储加息预期等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持宽幅区间震荡走势，主要受俄乌局势持续发酵、市场供求变动及美联储加息幅度预期下调等因素共同影响，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，掉期点区间震荡，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87个点，上周最高1218、最低220，收于1160，波幅93.01%。
- 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189个点，上周最高6.4578、最低6.4102，收于6.4500，波幅0.74%。

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	—	—	6.3288	-58	-458	-469
银行间市场汇价	6.3240	6.3048	6.3189	47	-447	-541
掉期点						
1 个月期限	168	140	142.50	4	-16.50	-46.50
2 个月期限	285.31	269	270	-3	-5	-26
3 个月期限	396.50	369	380	11	7	-50
6 个月期限	713	0	670.50	25.50	20.50	-129.50
1 年期限	1218	220	1160	87	85	-334

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	6.3516	6.3102	6.3370	-21	-389	38
2 个月期限	6.3659	6.3242	6.3525	23	-389	66
3 个月期限	6.3811	6.3362	6.3655	-5	-389	86
6 个月期限	6.4448	6.3706	6.3998	84	-451	138.50
1 年期限	6.4578	6.4102	6.4500	189	-669	146

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。