

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年3月7日-3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（3月11日）报6.3306，较前周贬值约0.03%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.06%，上周最高6.3089、最低6.3402，收于6.3228，波幅0.50%。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、美联储加息预期不断强化等因素共同影响。预计本周人民币汇率小幅走贬，主要受中美十年期国债利差边际收窄、国际金融市场避险情绪发酵等因素共同影响，人民币汇率将在6.3200-6.3600区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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100个点，上周最高1215、最低1056，收于1060，波幅13.71%。
- 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253个点，上周最高6.4835、最低6.4231，收于6.4753，波幅0.93%。

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	—	—	6.3306	18	-440	-451
银行间市场汇价	6.3402	6.3089	6.3228	39	-408	-502
掉期点						
1 个月期限	158	135	135	-7.50	-24	-54
2 个月期限	279	256	256	-14	-19	-40
3 个月期限	397	359	370	-10	-3	-60
6 个月期限	699	622	622	-48.50	-28	-178
1 年期限	1215	1056	1060	-100	-15	-434

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	6.3793	6.3170	6.3718	348	-41	355
2 个月期限	6.3935	6.3310	6.3853	328	-61	369
3 个月期限	6.4050	6.3440	6.3968	313	-76	370
6 个月期限	6.4355	6.3750	6.4273	275	-176	423
1 年期限	6.4835	6.4231	6.4753	253	-416	465

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。