

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年1月4日-1月7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（1月7日）报 6.3742，较前周升值约 0.02%。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 6.3640、最低 6.3832，收于 6.3770，波幅为 0.30%。上周受变异病毒加速蔓延、美联储加息预期升温等因素影响，人民币对美元汇率小幅贬值。预计人民币汇率区间波动，受中美十年期国债利差收窄、客盘逢高结汇等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.3600-6.4100 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 97 个点，上周最高 1460、最低 1370，收于 1398，波幅为 6.02%。
- 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 43 个点，上周最高 6.5399、最低 6.4952，收于 6.5212，波幅为 0.69%。

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	—	—	6.3742	-15	-15	-15
银行间市场汇价	6.3640	6.3832	6.3770	220	220	220
掉期点						
1 个月期限	193	130	145	-45	-45	-45
2 个月期限	279	248	257	-39	-39	-39
3 个月期限	410	378	385	-45	-45	-45
6 个月期限	775	725	745	-55	-55	-55
1 年期限	1460	1370	1398	-97	-97	-97

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	6.4096	6.3641	6.3907	148	148	-7.5
2 个月期限	6.4216	6.3769	6.4037	123	123	10
3 个月期限	6.4387	6.3906	6.4177	133	133	150
6 个月期限	6.4775	6.4241	6.4542	93	93	387
1 年期限	6.5399	6.4952	6.5212	43	43	44

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。