

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年1月10日-1月14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14日）报6.3677，较前周升值约0.10%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.38%，上周最高6.3396、最低6.3768，收于6.3531，波幅为0.59%。上周主要受进出口数据好于预期、国内通胀水平下降等因素影响，人民币对美元汇率明显升值。预计人民币汇率高位震荡，受近期美元指数可能高位回落、我国对外贸易保持向好态势等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3200-6.3700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下行77个点，上周最高1385、最低1282，收于1321，波幅为7.37%。
- 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278个点，上周最高6.5349、最低6.4666，收于6.4934，波幅为1.05%。

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	—	—	6.3677	-65	-80	-80
银行间市场汇价	6.3768	6.3396	6.3531	-239	-199	-199
掉期点						
1个月期限	155	123	138	-7	-51	-51
2个月期限	263	240	259	2	-37	-37
3个月期限	390	360	370	-15	-60	-60
6个月期限	742	680	680	-65	-120	-120
1年期限	1385	1282	1321	-77	-174	-174

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	6.4047	6.3451	6.3704	-203	-55	35
2个月期限	6.4174	6.3576	6.3839	-198	-75	49
3个月期限	6.4335	6.3716	6.3969	-208	-75	68
6个月期限	6.4729	6.4066	6.4324	-218	-125	113
1年期限	6.5349	6.4666	6.4934	-278	-235	82

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。