

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2022年4月18日-4月22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（4月22日）报6.4596，较前周贬值约1.08%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约2.01%，上周最高6.3643、最低6.5068，收于6.5016，波幅为2.19%。上周受美联储主席鲍威尔发表鹰派言论、市场避险情绪升温等因素影响，人民币对美元汇率明显贬值。预计人民币汇率低位区间波动，受近期客户购汇意愿上升、市场预期总体稳定等因素共同影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.5000-6.6000区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，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100个点，上周最高637、最低518，收于540，波幅为18.59%。
- 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1249个点，上周最高6.6212、最低6.4351，收于6.5828，波幅为2.83%。

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	-	-	6.4596	700	1114	839
银行间市场汇价	6.5068	6.3643	6.5016	1304	1583	1286
掉期点						
1个月期限	115	90	94	-12	-26	-95
2个月期限	197	178	182	-22	-46	-114
3个月期限	278	246	253	-19	-64	-177
6个月期限	458	408	408	-38	-139	-392
1年期限	637	518	540	-100	-256	-954

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	6.5475	6.3707	6.5289	1410	1530	179
2个月期限	6.5633	6.3845	6.5449	1435	1535	251
3个月期限	6.5743	6.3960	6.5559	1435	1515	290
6个月期限	6.5983	6.4152	6.5635	1276	1186	211
1年期限	6.6212	6.4351	6.5828	1249	659	272

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。