

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 1 月 3 日-1 月 6 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 6 日）报 6.8912，较前周升值约 1.07%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 1.35%，上周最高 6.8235、最低 6.9248，收于 6.8588，波幅为 1.48%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 14 个点，上周最高-1890、最低-1995，收于-1966，波幅为 5.34%。
- 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 932 个点，上周最高 6.7788、最低 6.6526，收于 6.6655，波幅为 1.89%。

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	—	—	6.8912	-734	-734	-734
银行间市场汇价	6.9248	6.8235	6.8588	-926	-926	-926
掉期点						
1 个月期限	-142	-168.18	-151.5	8	8	8
2 个月期限	-300	-318	-311	18	18	18
3 个月期限	-481.5	-505	-496.5	11	11	11
6 个月期限	-980.5	-1040	-1030	10	10	10
1 年期限	-1890	-1995	-1966	14	14	14

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	6.9134	6.8025	6.8085	-892	-892	-351
2 个月期限	6.9018	6.7881	6.7945	-892	-892	-332
3 个月期限	6.8873	6.7750	6.7810	-892	-892	-281
6 个月期限	6.8453	6.1625	6.7410	-882	-882	-148
1 年期限	6.7788	6.6526	6.6655	-932	-932	33

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。