

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023年1月9日-1月13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13日）报6.7292，较前周升值约2.41%。银行间市场人民币汇率较前周升值约2.22%，上周最高6.7038、最低6.8160，收于6.7099，波幅为1.67%。
- 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396个点，上周最高-425、最低-1880，收于-1570，波幅为92.68%。
- 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1020个点，上周最高6.6775、最低6.5528，收于6.5635，波幅为1.90%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.7292	-1620	-2354	-2354
银行间市场汇价	6.8160	6.7038	6.7099	-1489	-2415	-2415
<b>掉期点</b>						
1个月期限	-118	-158	-125	27	34	34
2个月期限	-251	-310	-262	49	67	67
3个月期限	-161	-516	-422	75	85	85
6个月期限	-810	-980	-845	185	195	195
1年期限	-425	-1880	-1570	396	410	410

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	6.8170	6.6829	6.6870	-1215	-2107	-104
2个月期限	6.8055	6.6716	6.6740	-1205	-2097	-97
3个月期限	6.7930	6.6576	6.6615	-1195	-2087	-62
6个月期限	6.7535	6.6207	6.6280	-1130	-2012	26
1年期限	6.6775	6.5528	6.5635	-1020	-1952	106

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。