

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 5 月 4 日-5 月 5 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（5 月 5 日）报 6.9114，较前周升值约 0.18%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.25%，上周最高 6.8888、最低 6.9217，收于 6.9114，波幅为 0.48%。
- 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 75 个点，上周最高-1721、最低-1770，收于-1765，波幅为 2.78%。
- 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 3 个点，上周最高 6.8026、最低 6.7262，收于 6.7496，波幅为 1.13%。

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	-	-	6.9114	-126	-126	-532
银行间市场汇价	6.9217	6.8888	6.9114	-170	-170	-400
掉期点						
1 个月期限	-182	-198	-198	-6	-6	-39
2 个月期限	-379	-385	-385	-6	-6	-56
3 个月期限	-546	-567	-566	12	12	-59
6 个月期限	-1050	-1092	-1083	15	15	-43
1 年期限	-1721	-1770	-1765	75	75	215

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	6.9401	6.8692	6.8982	-49	5	66
2 个月期限	6.9266	6.8542	6.8827	-68	-10	98
3 个月期限	6.9110	6.8367	6.8667	-53	-35	119
6 个月期限	6.8683	6.7910	6.8113	-58	-179	82
1 年期限	6.8026	6.7262	6.7496	-3	-91	147

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。