

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023年6月5日-6月9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（6月9日）报7.1115，较前周贬值约0.25%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.69%，上周最高7.0920、最低7.1425，收于7.1241，波幅为0.71%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期掉期点较前周下行148个点，上周最高-2305、最低-2425，收于-2410，波幅为4.98%。
- 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335个点，上周最高6.9610、最低6.8870，收于6.9340，波幅为1.07%。

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	-	-	7.1115	176	294	1469
银行间市场汇价	7.1425	7.0920	7.1241	491	176	1727
掉期点						
1 个月期限	-220	-260	-230	5	8	-71
2 个月期限	-453	-482	-474	1	-9	-145
3 个月期限	-473	-712	-702	-1	18	-195
6 个月期限	-1295	-1360	-1354	-44	-4	-314
1 年期限	-2305	-2425	-2410	-148	-15	-430

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	7.1287	7.0560	7.1140	335	2163	129
2 个月期限	7.1096	7.0395	7.0985	355	2148	218
3 个月期限	7.0930	7.0324	7.0820	370	2118	281
6 个月期限	7.0415	6.9750	7.0212	320	1920	325
1 年期限	6.9610	6.8870	6.9340	335	1753	509

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。