

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023年9月4日-9月8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（9月8日）报 7.2150，较前周贬值约 0.50%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 1.07%，上周最高 7.2551、最低 7.3510，收于 7.3415，波幅为 1.31%。
- 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 52 个点，上周最高-2544、最低-2620，收于-2600，波幅为 2.92%。
- 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 832 个点，上周最高 7.1728、最低 7.0447，收于 7.1570，波幅为 1.79%。

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	—	—	7.2150	362	339	2504
银行间市场汇价	7.3510	7.2551	7.3415	782	511	3901
掉期点						
1 个月期限	-80	-241	-197	40	43	-38
2 个月期限	-419	-445	-425	13	15	-96
3 个月期限	-638	-670	-643	13	11	-136
6 个月期限	-1300	-1360	-1313	-2	7	-273
1 年期限	-2544	-2620	-2600	-52	-33	-620

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	7.2715	7.1839	7.2585	577	3608	-633
2 个月期限	7.2855	7.1930	7.2700	607	3863	-290
3 个月期限	7.2840	7.1853	7.2705	677	4003	-67
6 个月期限	7.2600	7.1474	7.2450	797	4158	348
1 年期限	7.1728	7.0447	7.1570	832	3983	757

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。