

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023年9月11日-9月15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15日）报 7.1786，较前周升值约 0.51%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 1.00%，上周最高 7.2400、最低 7.3416，收于 7.2691，波幅为 1.40%。
- 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 40 个点，上周最高-2530、最低-2622，收于-2560，波幅为 3.59%。
- 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 640 个点，上周最高 7.1822、最低 7.0804，收于 7.1070，波幅为 1.43%。

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	-	-	7.1786	-364	-25	2140
银行间市场汇价	7.3416	7.2400	7.2691	-724	-213	3177
掉期点						
1 个月期限	-181	-217	-200	-3	40	-41
2 个月期限	-394	-430	-420	5	20	-91
3 个月期限	-626	-650	-637	6	17	-130
6 个月期限	-1264	-1317	-1289	24	31	-249
1 年期限	-2530	-2622	-2560	40	7	-580

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	7.2697	7.1805	7.2070	-620	3093	-421
2 个月期限	7.2858	7.1930	7.2195	-602	3358	-76
3 个月期限	7.2838	7.1926	7.2200	-618	3498	146
6 个月期限	7.2618	7.1643	7.1920	-645	3628	518
1 年期限	7.1822	7.0804	7.1070	-640	3483	939

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。