

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 9 月 18 日-9 月 22 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 22 日）报 7.1729，较前周升值约 0.08%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.43%，上周最高 7.2757、最低 7.3108，收于 7.3002，波幅为 0.48%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周下行 80 个点，上周最高-2535、最低-2655，收于-2640，波幅为 4.55%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：截至上周五 17:00，1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行 185 个点，上周最高 7.1430、最低 7.0960，收于 7.1230，波幅为 0.66%。

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	—	—	7.1729	-57	-82	2083
银行间市场汇价	7.3108	7.2757	7.3002	311	98	3488
掉期点						
1 个月期限	-186	-220	-194	6	46	-35
2 个月期限	-411	-432	-418	2	22	-89
3 个月期限	-612	-646	-625	12	29	-118
6 个月期限	-1264	-1305	-1285	4	35	-245
1 年期限	-2535	-2655	-2640	-80	-73	-660

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	7.2355	7.1967	7.2090	-62	2770	-718
2 个月期限	7.2495	7.2082	7.2235	55	3055	-349
3 个月期限	7.2505	7.2085	7.2260	75	3220	-117
6 个月期限	7.2235	7.1805	7.2020	115	3388	303
1 年期限	7.1430	7.0960	7.1230	185	3300	868

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。