

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 10 月 23 日-10 月 27 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（10 月 27 日）报 7.1782，较前周升值约 0.02%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.02%，上周最高 7.2961、最低 7.3203，收于 7.3166，波幅为 0.33%。
- 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 83 个点，上周最高-2631、最低-2735，收于-2728，波幅为 3.81%。
- 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 68 个点，上周最高 7.1610、最低 7.1056，收于 7.1395，波幅为 0.78%。

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	—	—	7.1782	-11	-16	2136
银行间市场汇价	7.3203	7.2961	7.3166	16	164	3652
掉期点						
1 个月期限	-206	-246	-209	-7	0	-50
2 个月期限	-412	-430	-419	-1	14	-90
3 个月期限	-627	-669	-666	-41	-15	-159
6 个月期限	-1282	-1355	-1335	-45	-15	-295
1 年期限	-2631	-2735	-2728	-83	-3	-748

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	7.2258	7.1778	7.1915	-194	2595	-1042
2 个月期限	7.2375	7.1989	7.2080	-206	2900	-667
3 个月期限	7.2524	7.1980	7.2180	-193	3140	-320
6 个月期限	7.2354	7.1900	7.2045	-137	3413	214
1 年期限	7.1610	7.1056	7.1395	68	3465	957

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。