

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 11 月 20 日-11 月 24 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（11 月 24 日）报 7.1151，较前周升值约 0.81%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 1.31%，上周最高 7.1256、最低 7.2075，收于 7.1529，波幅为 1.14%。
- 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 30 个点，上周最高-2502、最低-2598，收于-2585，波幅为 3.71%。
- 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）较前周下行 925 个点，上周最高 7.0546、最低 6.9257，收于 6.9635，波幅为 1.85%。

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<br>(点) | 较上月末<br>(点) | 较去年末<br>(点) |
|-------------|--------|--------|--------|------------|-------------|-------------|
| <b>即期汇率</b> |        |        |        |            |             |             |
| 中间价         | —      | —      | 7.1151 | -577       | -628        | 1505        |
| 银行间市场汇价     | 7.2075 | 7.1256 | 7.1529 | -936       | -1647       | 2015        |
| <b>掉期点</b>  |        |        |        |            |             |             |
| 1 个月期限      | -203   | -228   | -209   | -1         | 9           | -50         |
| 2 个月期限      | -426   | -449   | -443   | -2         | -15         | -114        |
| 3 个月期限      | -210   | -679   | -656   | -1         | -4          | -149        |
| 6 个月期限      | -1278  | -1322  | -1306  | -11        | 38          | -266        |
| 1 年期限       | -2502  | -2598  | -2585  | -30        | 100         | -605        |

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<br>(点) | 较去年末<br>(点) | 与境内价<br>差 (点) |
|--------|--------|--------|--------|------------|-------------|---------------|
| 1 个月期限 | 7.1675 | 7.0757 | 7.1035 | -605       | 1715        | -285          |
| 2 个月期限 | 7.1595 | 7.0568 | 7.0900 | -660       | 1720        | -186          |
| 3 个月期限 | 7.1500 | 7.0442 | 7.0770 | -710       | 1730        | -103          |
| 6 个月期限 | 7.1247 | 7.0052 | 7.0405 | -825       | 1773        | 182           |
| 1 年期限  | 7.0546 | 6.9257 | 6.9635 | -925       | 1705        | 691           |

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。