

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023年11月27日-12月1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7.1104，较前周升值约0.07%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约0.18%，上周最高7.1162、最低7.1577，收于7.1400，波幅为0.58%。
- 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95个点，上周最高-2477、最低-2594，收于-2490，波幅为4.70%。
- 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50个点，上周最高6.9750、最低6.8924，收于6.9585，波幅为1.19%。

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	-	-	7.1104	-47	86	1458
银行间市场汇价	7.1577	7.1162	7.1400	-129	90	1886
掉期点						
1 个月期限	-198	-225	-215	-6	1	-56
2 个月期限	-433	-446	-439	4	6	-110
3 个月期限	-637	-659	-644	12	-1	-137
6 个月期限	-1273	-1381	-1294	12	-5	-254
1 年期限	-2477	-2594	-2490	95	20	-510

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	7.1165	7.0516	7.0910	-125	1590	-275
2 个月期限	7.0995	7.0345	7.0760	-140	1580	-201
3 个月期限	7.0872	7.0089	7.0660	-110	1620	-96
6 个月期限	7.0526	6.9862	7.0330	-75	1698	224
1 年期限	6.9750	6.8924	6.9585	-50	1655	675

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。