

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 1 月 8 日-1 月 12 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（1 月 12 日）报 7.1050，较前周贬值约 0.03%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.08%，上周最高 7.1450、最低 7.1772，收于 7.1622，波幅为 0.45%。
- 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 83 个点，上周最高-2375、最低-2507，收于-2415，波幅为 5.47%。
- 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 105 个点，上周最高 7.0050、最低 6.9432，收于 6.9790，波幅为 0.89%。

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	—	—	7.1050	21	223	223
银行间市场汇价	7.1772	7.1450	7.1622	56	702	702
掉期点						
1 个月期限	4	-286	-236	-17	-28	-28
2 个月期限	-137	-428	-425	12	-2	-2
3 个月期限	-620	-646	-625	19	10	10
6 个月期限	-1174	-1278	-1234	58	14	14
1 年期限	-2375	-2507	-2415	83	0	0

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	7.1247	7.0686	7.0985	5	250	-401
2 个月期限	7.1150	7.0636	7.0925	20	300	-272
3 个月期限	7.1100	7.0498	7.0835	20	345	-162
6 个月期限	7.0709	7.0153	7.0485	85	370	97
1 年期限	7.0050	6.9432	6.9790	105	305	583

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。