

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年1月22日-1月26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26日）报7.1074，较前周升值约0.13%。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7.1420、最低7.1979，收于7.1808，波幅为0.78%。
- 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17个点，上周最高-2430、最低-2510，收于-2448，波幅为3.27%。
- 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280个点，上周最高7.0327、最低6.9515，收于6.9890，波幅为1.16%。

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	-	-	7.1074	-93	247	247
银行间市场汇价	7.1979	7.1420	7.1808	-130	888	888
掉期点						
1 个月期限	-204	-234	-208	6	0	0
2 个月期限	-410	-424	-410	20	13	13
3 个月期限	-622	-637	-634	-1	1	1
6 个月期限	-1240	-1300	-1259	4	-11	-11
1 年期限	-2430	-2510	-2448	17	-33	-33

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	7.1380	7.0556	7.0910	-220	175	-690
2 个月期限	7.1321	7.0520	7.0860	-250	235	-538
3 个月期限	7.1362	7.0458	7.0795	-260	305	-379
6 个月期限	7.0981	7.0097	7.0510	-255	395	-39
1 年期限	7.0327	6.9515	6.9890	-280	405	530

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。