

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年2月19日-2月23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（2月23日）报7.1064，较2月9日贬值约0.04%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较2月9日贬值约0.08%，上周最高7.1774、最低7.2002，收于7.1984，波幅为0.32%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期掉期点较2月9日下行166个点，上周最高-2395、最低-2720，收于-2691，波幅为12.08%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较2月9日下行205个点，上周最高7.0341、最低6.9713，17:00收于6.9960，波幅为0.90%。

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 2 月 9 日 (点)	较上月末 (点)	较去年末 (点)
即期汇率						
中间价	-	-	7.1064	28	25	237
银行间市场汇价	7.2002	7.1774	7.1984	57	289	1064
掉期点						
1 个月期限	-189	-213	-206	-15	0	2
2 个月期限	-415	-450	-447	-25	-35	-24
3 个月期限	-626	-663	-654	-35	-4	-19
6 个月期限	-1283	-1353	-1348	-78	-92	-100
1 年期限	-2395	-2720	-2691	-166	-206	-276

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 2 月 9 日 (点)	较去年末 (点)	与境内价差 (点)
1 个月期限	7.1266	7.0681	7.1047	-138	312	-731
2 个月期限	7.1220	7.0697	7.0996	-97	371	-541
3 个月期限	7.1193	7.0637	7.1005	-80	515	-325
6 个月期限	7.0980	7.0314	7.0655	-76	540	19
1 年期限	7.0341	6.9713	6.9960	-205	475	667

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。