

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 3 月 25 日-3 月 29 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（3 月 29 日）报 7.0950，较前周升值约 0.08%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.07%，上周最高 7.1902、最低 7.2307，收于 7.2232，波幅为 0.56%。
- 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 35 个点，上周最高-2007、最低-2690，收于-2675，波幅为 25.53%。
- 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 29 个点，上周最高 7.0732、最低 7.0010，收于 7.0474，波幅为 1.02%。

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	—	—	7.0950	-54	-86	123
银行间市场汇价	7.2307	7.1902	7.2232	-51	302	1312
掉期点						
1 个月期限	-226	-246	-236	-17	4	-28
2 个月期限	-431	-457	-438	10	5	-15
3 个月期限	-645	-669	-649	11	1	-14
6 个月期限	-1331	-1380	-1377	-41	-49	-129
1 年期限	-2007	-2690	-2675	-35	-12	-260

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	7.1485	7.0939	7.1145	-240	410	-851
2 个月期限	7.1585	7.0955	7.1195	-190	570	-599
3 个月期限	7.1525	7.0915	7.1214	-121	724	-369
6 个月期限	7.1387	7.0660	7.1034	27	919	179
1 年期限	7.0732	7.0010	7.0474	29	989	917

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。