

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年4月1日-4月3日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周三（4月3日）报 7.0949，与前周基本持平。截至上周三 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.17%，上周最高 7.2227、最低 7.2364，收于 7.2356，波幅为 0.19%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周三 16:30，1年期掉期点较前周下行 42 个点，上周最高-2618、最低-2729，收于-2717，波幅为 4.09%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：截至上周三 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 54 个点，上周最高 7.0544、最低 7.0300，收于 7.0340，波幅为 0.35%。

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	-	-	7.0949	-1	-1	122
银行间市场汇价	7.2364	7.2227	7.2356	124	124	1436
掉期点						
1 个月期限	-210	-234	-215	21	21	-7
2 个月期限	-427	-460	-455	-17	-17	-32
3 个月期限	-635	-683	-662	-13	-13	-27
6 个月期限	-1331	-1364	-1356	21	21	-108
1 年期限	-2618	-2729	-2717	-42	-42	-302

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	7.1239	7.0975	7.1145	0	410	-996
2 个月期限	7.1304	7.0999	7.1190	-5	565	-711
3 个月期限	7.1294	7.1008	7.1212	-2	722	-482
6 个月期限	7.1309	7.0822	7.1025	-9	910	25
1 年期限	7.0544	7.0300	7.0420	-54	935	781

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。