

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 4 月 22 日-4 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（4 月 26 日）报 7.1056，较前周贬值约 0.01%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.09%，上周最高 7.2355、最低 7.2478，收于 7.2463，波幅为 0.17%。
- 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 62 个点，上周最高-2815、最低-3005，收于-2870，波幅为 6.62%。
- 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 72 个点，上周最高 7.0745、最低 7.0430，收于 7.0518，波幅为 0.45%。

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	—	—	7.1056	10	106	229
银行间市场汇价	7.2478	7.2355	7.2463	62	231	1543
掉期点						
1 个月期限	-212	-262	-231	-13	5	-23
2 个月期限	-438	-485	-445	8	-7	-22
3 个月期限	-670	-715	-695	-26	-46	-60
6 个月期限	-1390	-1495	-1426	-49	-49	-178
1 年期限	-2815	-3005	-2870	-62	-195	-455

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	7.1325	7.0958	7.1010	-180	275	-1222
2 个月期限	7.1455	7.1027	7.1154	-146	529	-864
3 个月期限	7.1445	7.1059	7.1162	-163	672	-606
6 个月期限	7.1473	7.0948	7.1060	-110	945	23
1 年期限	7.0745	7.0430	7.0518	-72	1033	925

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。