

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年5月6日-5月10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（5月10日）报7.1011，较前周升值约0.07%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约0.24%，上周最高7.1922、最低7.2287，收于7.2246，波幅为0.51%。
- 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-2715、最低-2828，收于-2793，波幅为4.05%。
- 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314个点，上周最高7.0335、最低6.9900，收于7.0140，波幅为0.62%。

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	-	-	7.1011	-52	-52	184
银行间市场汇价	7.2287	7.1922	7.2246	-170	-170	1326
掉期点						
1 个月期限	-220	-251	-223	5	5	-15
2 个月期限	-438	-468	-454	0	0	-31
3 个月期限	-672	-698	-677	7	7	-42
6 个月期限	-1373	-1420	-1396	7	7	-148
1 年期限	-2715	-2828	-2793	17	17	-378

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	7.1283	7.0790	7.1025	-57	290	-998
2 个月期限	7.1310	7.0765	7.0985	-160	360	-807
3 个月期限	7.1183	7.0740	7.0950	-139	460	-619
6 个月期限	7.1011	7.0535	7.0730	-225	615	-120
1 年期限	7.0335	6.9900	7.0140	-314	655	687

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。