

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 5 月 20 日-5 月 24 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 24 日）报 7.1102，较前周贬值约 0.08%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.28%，上周最高 7.2280、最低 7.2460，收于 7.2447，波幅为 0.25%。
- 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 15 个点，上周最高-2870、最低-2943，收于-2899，波幅为 2.52%。
- 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 120 个点，上周最高 7.0420、最低 6.9990，收于 7.0310，波幅为 0.61%。

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	—	—	7.1102	57	39	275
银行间市场汇价	7.2460	7.2280	7.2447	205	31	1527
掉期点						
1 个月期限	-223	-245	-231	-5	-3	-23
2 个月期限	-455	-468	-466	5	-12	-43
3 个月期限	-683	-718	-703	2	-19	-68
6 个月期限	-1438	-1472	-1460	-13	-57	-212
1 年期限	-2870	-2943	-2899	-15	-89	-484

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	7.1284	7.0890	7.1150	124	415	-1066
2 个月期限	7.1201	7.0831	7.1074	24	449	-907
3 个月期限	7.1178	7.0837	7.1110	105	620	-634
6 个月期限	7.1020	7.0650	7.0915	205	800	-72
1 年期限	7.0420	6.9990	7.0310	120	825	762

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。