

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 5 月 27 日-5 月 31 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 31 日）报 7.1088，较前周升值约 0.02%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.01%，上周最高 7.2220、最低 7.2499，收于 7.2440，波幅为 0.39%。
- 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 7 个点，上周最高-2860、最低-2937，收于-2906，波幅为 2.65%。
- 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 25 个点，上周最高 7.0535、最低 7.0035，收于 7.0335，波幅为 0.71%。

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	—	—	7.1088	-14	25	261
银行间市场汇价	7.2499	7.2220	7.2440	-7	24	1520
掉期点						
1 个月期限	-14	-231	-228	3	0	-20
2 个月期限	-411	-481	-467	-1	-13	-44
3 个月期限	-696	-711	-703	0	-19	-68
6 个月期限	-1435	-1455	-1443	17	-40	-195
1 年期限	-2860	-2937	-2906	-7	-96	-491

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	7.1354	7.0789	7.1095	-55	360	-1117
2 个月期限	7.1220	7.0854	7.1090	16	465	-883
3 个月期限	7.1205	7.0796	7.1065	-45	575	-672
6 个月期限	7.1208	7.0645	7.0930	15	815	-67
1 年期限	7.0535	7.0035	7.0335	25	850	801

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。