

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年6月3日-6月7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（6月7日）报 7.1106，较前周贬值约 0.03%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.02%，上周最高 7.2360、最低 7.2485，收于 7.2426，波幅为 0.17%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 23 个点，上周最高-2875、最低-2930，收于-2883，波幅为 1.91%。
- 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 15 个点，上周最高 7.0475、最低 7.0064，收于 7.0320，波幅为 0.58%。

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	—	—	7.1106	18	18	279
银行间市场汇价	7.2485	7.2360	7.2426	-14	-14	1506
掉期点						
1 个月期限	-219	-240	-231	-3	-3	-23
2 个月期限	-460	-474	-470	-3	-3	-47
3 个月期限	-700	-720	-713	-10	-10	-78
6 个月期限	-1431	-1462	-1447	-4	-4	-199
1 年期限	-2875	-2930	-2883	23	23	-468

数据来源：Refinitiv

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	7.1272	7.0846	7.1030	-65	295	-1165
2 个月期限	7.1198	7.0799	7.1020	-70	395	-936
3 个月期限	7.1173	7.0772	7.0942	-123	452	-771
6 个月期限	7.1103	7.0625	7.0814	-116	699	-165
1 年期限	7.0475	7.0064	7.0320	-15	835	777

数据来源：Refinitiv

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。