

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年6月17日-6月21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21日）报7.1196，较前周贬值约0.06%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.08%，上周最高7.2535、最低7.2618，收于7.2613，波幅为0.11%。
- 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21个点，上周最高-2882、最低-2962，收于-2930，波幅为2.73%。
- 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157个点，上周最高7.0679、最低7.0298，收于7.0637，波幅为0.54%。

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	-	-	7.1196	45	108	369
银行间市场汇价	7.2618	7.2535	7.2613	56	173	1693
掉期点						
1 个月期限	-229	-260	-232	2	-4	-24
2 个月期限	-428	-500	-486	-3	-19	-63
3 个月期限	-568	-748	-728	-1	-25	-93
6 个月期限	-1450	-1505	-1484	-13	-41	-236
1 年期限	-2882	-2962	-2930	-21	-24	-515

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	7.1299	7.0946	7.1227	106	492	-1154
2 个月期限	7.1282	7.1005	7.1237	141	612	-890
3 个月期限	7.1258	7.0975	7.1212	148	722	-673
6 个月期限	7.1192	7.0785	7.1082	160	967	-47
1 年期限	7.0679	7.0298	7.0637	157	1152	954

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。