

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 7 月 29 日-8 月 2 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（8 月 2 日）报 7.1376，较前周贬值约 0.15%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.53%，上周最高 7.2653、最低 7.1524，收于 7.2150，波幅为 1.56%。
- 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 146 个点，上周最高-2462、最低-2920，收于-2764，波幅为 16.57%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行 375 个点，上周最高 7.0670、最低 6.9475，17:00 收于 7.0050，波幅为 1.71%。

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	—	—	7.1376	106	30	549
银行间市场汇价	7.2653	7.1524	7.2150	-386	-111	1230
掉期点						
1 个月期限	-244	-288	-267	5	1	-59
2 个月期限	-522	-578	-534	-1	32	-111
3 个月期限	-748	-800	-770	3	12	-135
6 个月期限	-1488	-1561	-1492	9	45	-244
1 年期限	-2462	-2920	-2764	146	114	-349

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。

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	7.1383	7.0784	7.1205	0	470	-678
2 个月期限	7.1433	7.0714	7.1135	-40	510	-481
3 个月期限	7.1398	7.0625	7.1055	-85	565	-325
6 个月期限	7.1172	7.0210	7.0675	-260	560	17
1 年期限	7.0670	6.9475	7.0050	-375	565	664

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。