

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年9月9日-9月13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（9月13日）报7.1030，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贬值约0.09%，上周最高7.0905、最低7.1258，收于7.0943，波幅为0.50%。
- 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89个点，上周最高-2015、最低-2220，收于-2036，波幅为10.07%。
- 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180个点，上周最高6.9467、最低6.8810，收于6.9135，波幅为0.95%。

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	-	-	7.1030	105	-94	203
银行间市场汇价	7.1258	7.0905	7.0943	61	62	23
掉期点						
1个月期限	-220	-255	-227	-1	32	-19
2个月期限	-440	-456	-440	17	3	-17
3个月期限	-601	-660	-619	31	24	16

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。

6 个月期限	-1135	-1240	-1143	64	37	105
1 年期限	-2015	-2220	-2036	89	3	379

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	7.1020	7.0530	7.0615	100	-120	-101
2 个月期限	7.0775	7.0297	7.0410	130	-215	-93
3 个月期限	7.0572	7.0102	7.0225	120	-265	-99
6 个月期限	7.0072	6.9622	6.9745	130	-370	-55
1 年期限	6.9467	6.8810	6.9135	180	-350	228

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。