

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年9月18日-9月20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20日）报7.0644，较前周升值约0.55%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值0.55%，上周最高7.0420、最低7.1099，收于7.0552，波幅为0.96%。
- 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189个点，上周最高-1788、最低-2046，收于-1847，波幅为13.97%。
- 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320个点，上周最高6.9380、最低6.8450，收于6.8815，波幅为1.35%。

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)
<strong>即期汇率</strong>						
中间价	-	-	7.0644	-386	-480	-183
银行间市场汇价	7.1099	7.0420	7.0552	-391	-329	-368
<strong>掉期点</strong>						
1个月期限	-185	-217	-193	34	66	15
2个月期限	-378	-422	-382	58	61	41
3个月期限	-536	-620	-549	70	94	86

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	-988	-1140	-1010	133	170	238
1 年期限	-1788	-2046	-1847	189	192	568

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	7.0820	7.0085	7.0245	-370	-490	-114
2 个月期限	7.0625	6.9865	7.0025	-385	-600	-145
3 个月期限	7.0445	6.9680	6.9865	-360	-625	-138
6 个月期限	6.9980	6.9235	6.9395	-350	-720	-147
1 年期限	6.9380	6.8450	6.8815	-320	-670	110

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。