

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 9 月 23 日-9 月 27 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 27 日）报 7.0101，较前周升值约 0.77%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值 0.56%，上周最高 7.0012、最低 7.0640，收于 7.0160，波幅为 0.90%。
- 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 102 个点，上周最高-1700、最低-1924，收于-1745，波幅为 12.84%。
- 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 500 个点，上周最高 6.9015、最低 6.7985，收于 6.8315，波幅为 1.51%。

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	-	-	7.0101	-543	-1023	-726
银行间市场汇价	7.0640	7.0012	7.0160	-392	-721	-760
掉期点						
1 个月期限	-180	-219	-197	-4	62	11
2 个月期限	-355	-403	-366	16	77	57
3 个月期限	-519	-583	-528	21	115	107

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	-965	-1060	-974	36	206	274
1 年期限	-1700	-1924	-1745	102	294	670

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	7.0470	6.9470	6.9680	-565	-1055	-283
2 个月期限	7.0245	6.9240	6.9475	-550	-1150	-319
3 个月期限	7.0055	6.8980	6.9255	-610	-1235	-377
6 个月期限	6.9625	6.8570	6.8805	-590	-1310	-381
1 年期限	6.9015	6.7985	6.8315	-500	-1170	-100

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。