工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年9月30日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周一（9月30日）报7.0074，较前周升值约0.04%。截至上周一16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值0.01%，上周最高7.0108、最低7.0200，收于7.0156，波幅为0.13%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周一16:30，1年期掉期点较前周上行30个点，上周最高-1680、最低-1740，收于-1715，波幅为3.50%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：截至上周一17:00，1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行30个点，上周最高6.8535、最低6.8090，收于6.8350，波幅为0.65%。

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	-	-	7.0074	-27	-1050	-753
银行间市场汇价	7.0200	7.0108	7.0156	-4	-725	-764
掉期点						
1个月期限	-211	-225	-211	-14	48	-3
2个月期限	-364	-380	-364	2	79	59
3个月期限	-530	-550	-530	-2	113	105

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	-961	-970	-962	12	218	286
1 年期限	-1680	-1740	-1715	30	324	700

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	6.9905	6.9500	6.9715	35	-1020	-230
2 个月期限	6.9720	6.9285	6.9530	55	-1095	-262
3 个月期限	6.9545	6.9100	6.9350	95	-1140	-276
6 个月期限	6.9125	6.8585	6.8920	115	-1195	-274
1 年期限	6.8535	6.8090	6.8345	30	-1140	-96

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。