

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年10月8日-10月11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（10月11日）报 7.0731，较前周贬值约 0.93%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.74%，上周最高 7.0480、最低 7.0846，收于 7.0676，波幅为 0.52%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周下行 109 个点，上周最高-1815、最低-1905，收于-1824，波幅为 4.93%。
- 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 25 个点，上周最高 6.9295、最低 6.8700，收于 6.8985，波幅为 0.86%。

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	-	-	7.0731	657	657	-96
银行间市场汇价	7.0846	7.0480	7.0676	520	520	-244
掉期点						
1 个月期限	-179	-222	-180	31	31	28
2 个月期限	-350	-392	-350	14	14	73
3 个月期限	-511	-578	-512	18	18	123

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	-971	-1045	-975	-13	-13	273
1 年期限	-1815	-1905	-1824	-109	-109	591

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	7.0635	7.0100	7.0355	65	-380	-141
2 个月期限	7.0460	6.9904	7.0190	65	-435	-136
3 个月期限	7.0295	6.9633	7.0010	80	-480	-154
6 个月期限	6.9860	6.9188	6.9595	70	-520	-106
1 年期限	6.9295	6.8700	6.8985	25	-500	133

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。