

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年10月14日-10月18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18日）报7.1274，较前周贬值约0.76%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.51%，上周最高7.0722、最低7.1283，收于7.1035，波幅为0.79%。
- 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149个点，上周最高-1485、最低-2015，收于-1973，波幅为26.86%。
- 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385个点，上周最高6.9682、最低6.8935，收于6.9370，波幅为1.08%。

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	-	-	7.1274	543	1200	447
银行间市场汇价	7.1283	7.0722	7.1035	359	879	115
掉期点						
1个月期限	-178	-194	-178	2	33	30
2个月期限	-343	-368	-355	-5	9	68
3个月期限	-499	-537	-518	-6	12	117

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	-946	-1037	-1002	-27	-40	246
1 年期限	-1485	-2015	-1973	-149	-258	442

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	7.0960	7.0300	7.0695	340	-40	-162
2 个月期限	7.0827	7.0140	7.0525	335	-100	-155
3 个月期限	7.0640	6.9955	7.0365	355	-125	-152
6 个月期限	7.0282	6.9560	6.9975	380	-140	-58
1 年期限	6.9682	6.8935	6.9370	385	-115	308

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。