

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 11 月 4 日-11 月 8 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（11 月 8 日）报 7.1433，较前周贬值约 0.42%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.56%，上周最高 7.0858、最低 7.1950，收于 7.1648，波幅为 1.52%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 21 个点，上周最高-2064、最低-2262，收于-2134，波幅为 9.28%。
- 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 430 个点，上周最高 7.0375、最低 6.9077，收于 6.9950，波幅为 1.86%。

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	-	-	7.1433	298	183	606
银行间市场汇价	7.1950	7.0858	7.1648	398	488	728
掉期点						
1 个月期限	-159	-182	-162	4	1	46
2 个月期限	-332	-349	-335	9	9	88
3 个月期限	-500	-549	-508	14	10	127

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	-982	-1110	-1038	32	27	210
1 年期限	-2064	-2262	-2134	21	-3	281

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	7.1700	7.0447	7.1310	410	575	-176
2 个月期限	7.1600	7.0276	7.1140	410	515	-173
3 个月期限	7.1420	7.0116	7.1010	435	520	-130
6 个月期限	7.1020	6.9726	7.0630	445	515	20
1 年期限	7.0375	6.9077	6.9950	430	465	436

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。