

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024 年 12 月 9 日-12 月 13 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（12 月 13 日）报 7.1876，较前周贬值约 0.04%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.29%，上周最高 7.2385、最低 7.2827，收于 7.2795，波幅为 0.61%。
- 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 140 个点，上周最高-626、最低-2403，收于-2400，波幅为 74.04%。
- 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 210 个点，上周最高 7.1212、最低 7.0605，收于 7.1070，波幅为 0.85%。

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	-	-	7.1876	28	-1	1049
银行间市场汇价	7.2827	7.2385	7.2795	213	463	1875
掉期点						
1 个月期限	-171	-193	-176	5	-11	32
2 个月期限	-352	-363	-360	1	-3	63
3 个月期限	-503	-531	-528	-4	-22	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	-1073	-1135	-1132	-49	-70	116
1 年期限	-626	-2403	-2400	-140	-205	15

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	7.2085	7.1515	7.1930	190	1195	-689
2 个月期限	7.2062	7.1460	7.1900	205	1275	-535
3 个月期限	7.2032	7.1400	7.1865	235	1375	-402
6 个月期限	7.1802	7.1100	7.1630	235	1515	-33
1 年期限	7.1212	7.0605	7.1070	210	1585	675

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。