

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2024年3月18日-3月22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（3月22日）报7.1004，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0.44%，上周最高7.1920、最低7.2304，收于7.2283，波幅为0.53%。
- 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19个点，上周最高-2633、最低-2670，收于-2640，波幅为1.40%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行535个点，上周最高7.0640、最低6.9796，17:00收于7.0445，波幅为1.20%。

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。

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	-	-	7.1004	29	-32	177
银行间市场汇价	7.2304	7.1920	7.2283	318	353	1363
掉期点						
1 个月期限	-219	-237.5	-219	2	21	-11
2 个月期限	-438	-461.5	-448	-6	-5	-25
3 个月期限	0	-684	-660	7	-10	-25
6 个月期限	-1325.5	-1364.65	-1336	4	-8	-88
1 年期限	-2633	-2670	-2640	19	23	-225

数据来源：路透

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	7.1642	7.0705	7.1385	435	650	-679
2 个月期限	7.1585	7.0719	7.1385	480	760	-450
3 个月期限	7.1655	7.0741	7.1335	480	845	-288
6 个月期限	7.1286	7.0426	7.1007	427	892	60
1 年期限	7.0640	6.9796	7.0445	535	960	802

数据来源：路透

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。