

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 4 月 22 日-26 日)

## ◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 4 月 22 日-26 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.3%，并于周五（4 月 26 日）创 2005 年汇改以来新高，报 6.2208。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.2%，最高 6.1616，最低 6.1826，报收于 6.1650，波幅为 0.06%。全周市场交投活跃，日均波幅 35 个点，人民币汇率总体呈快速上涨态势。上周前三个交易日，市场观望情绪较浓，但客户结汇需求仍然偏多，人民币汇率小幅上涨；后两个交易日，受国际市场美元指数大幅下跌影响，人民币中间价连续高开，人民币汇率随之快速升值，周四突破 6.17 一线，并在周五触及 6.1616，再创汇改以来新高。外汇管理局上周公布数据显示，中国一季度经常项目顺差 552 亿美元，资本和金融项目顺差 1018 亿美元，预计短期内经常项和资本金融项双顺差的格局难以打破，对人民币形成较大升值压力。市场如无重大事件发生，预计本周人民币将会延续上周升值趋势，上方阻力位 6.1600，下方支撑位 6.1800。
- 人民币外汇掉期汇率：上周 1 年期美元对人民币外汇掉期点较

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。

前周上升 15 个点，最高 945，最低 860，报收于 885，波幅为 4.31%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投较活跃，日均波幅 40 个点，掉期点全周整体变动不大，呈区间震荡态势。

- 境外人民币无本金交割（NDF）远期汇率：1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较上周下跌 80 个点，上周最高 6.2265，最低 6.2590，报收于 6.2360，上周波幅为 0.24%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

即期汇率	最高价	最低价	收盘价	较上周 (BP)	较上月 (BP)	较年初 (BP)
中间价	—	—	6.2208	-187	-481	-689
银行间市场汇价	6.1616	6.1826	6.1650	-146	-338	-527
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	118	72	93	4	-10	-40
2 个月期限	208	180	186	8	-27	-77
3 个月期限	311	265	280	17	-34	-70
6 个月期限	538	480	500	25	-108	-130
1 年期限	945	860	885	15	-190	416

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割（NDF）远期汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较上周 (BP)	较年初 (BP)	与境内价差 (BP)
1 个月期限	6.2148	6.2430	6.2200	-170	-840	-455
2 个月期限	6.2105	6.2455	6.2200	-175	-870	-300
3 个月期限	6.2110	6.2450	6.2210	-160	-900	-281
6 个月期限	6.2155	6.2485	6.2245	-135	-775	-99
1 年期限	6.2265	6.2590	6.2360	-80	-930	180

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。