

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 4 月 29 日-5 月 3 日)

## ◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 4 月 29 日-5 月 3 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.15%，并于周四（5 月 2 日）创 2005 年汇改以来新高，报 6.2082。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.2%，最高 6.1537，最低 6.1602，报收于 6.1551，波幅为 0.1%。全周市场交投活跃，日均波幅 40 个点，人民币对美元汇率始终在区间上限附近波动。周一至周三，银行间外汇市场因假期休市；周四，受人民币中间价大幅走高影响，银行间外汇市场人民币对美元汇率上涨；周五，受隔夜欧元大跌影响，银行间外汇市场人民币对美元汇率小幅回落。4 月份，人民币中间价连续 9 次创下历史新高，银行间市场人民币对美元汇率累计升值幅度达到 0.77%，大于去年全年的幅度，人民币连续升值，巩固了市场对人民币升值的预期。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 6.1400，下方支撑位 6.1700。
- 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前周上升 10 个点，最高 910，最低 840，报收于 895，波幅为

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。

6.51%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投较活跃，日均波幅 39 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：上周 1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下跌 145 个点，最高 6.2427，最低 6.2195，报收于 6.2215，上周波幅为 0.37%。

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	—	—	6.2152	-56	-457	-747
银行间市场汇价	6.1602	6.1537	6.1551	-94	-454	-747
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	98	89	96.5	3.5	5.5	-36
2 个月期限	201	178	199	13	2	-63.5
3 个月期限	292	255	275	-5	-3	-75
6 个月期限	500	460	495	-5	-30	-135
1 年期期限	910	840	895	10	-75	-325

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	6.2183	6.2044	6.2060	-140	-980	408
2 个月期限	6.2298	6.2047	6.2060	-140	-1010	312
3 个月期限	6.2297	6.2050	6.2063	-147	-1047	227
6 个月期限	6.2345	6.2080	6.2100	-145	-1050	49
1 年期期限	6.2427	6.2195	6.2215	-145	-1075	233

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。