

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2014年12月29日-2014年12月31日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周下跌4个点，上周三（2014年12月31日）报6.1190。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨89个点，上周最高6.1908、最低6.2362，收于6.2040，波幅为0.73%。上周共三个交易日，人民币汇率整体呈现上涨行情。其中，上周一（2014年12月29日），受美指走升及离岸人民币下跌影响，人民币汇率自6.2110震荡下跌至6.2220附近。上周二（2014年12月30日），部分参与者在市场大量卖出美元，推动人民币大幅升值近300个点，一度触及6.1940一线。上周三，人民币汇率主要在6.1910至6.2090区间内震荡，最终收于6.2040。元旦假期期间国际市场美元上涨，加之新年伊始美元需求偏多，预计本周人民币汇率将呈现贬值行情，阻力位6.2000，支撑位6.2500。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投不活跃，2014年末最后三个交易日，各期限掉期价格震荡下跌。1-3个月短期限卖盘大量涌现，价格一路下跌；中长期受到短期限与境外CNH掉期市场下行的带动，整体呈现震荡下跌态势。上周一至上周三，1年期美元对人民币外汇掉期点较前周下跌85个点，上周最高

免责声明：本资讯由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）整理撰写，资讯所引用信息均来自公开资料，我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。资讯所载观点、结论及意见仅代表分析师在报告发布时的个人判断，不代表工商银行立场，亦不构成任何投资与交易决策依据。对于任何因使用或信赖本资讯而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本资讯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。

1680、最低 1572.5，收于 1585，波幅为 6.75%。

- 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）较前周下跌 115 个点，上周最高 6.3715、最低 6.3335，收于 6.3375，波幅为 0.60%。

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	—	—	6.1190	4	-155	221
银行间市场汇价	6.2362	6.1908	6.2040	-89	590	1501
掉期点						
1 个月期限	280	240	240	-38	15	120
2 个月期限	530	435	435	-83	35	255
3 个月期限	745	625	625	-65	75	390
6 个月期限	1060	1000	1010	-50	150	665
1 年期期限	1680	1572.5	1585	-85	235	1135

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	6.1605	6.1420	6.1550	120	490	-730
2 个月期限	6.1850	6.1640	6.1755	75	685	-720
3 个月期限	6.2180	6.1940	6.2025	75	935	-640
6 个月期限	6.2760	6.2500	6.2570	20	1430	-480
1 年期期限	6.3715	6.3335	6.3375	-115	2155	-250

数据来源：路透

免责声明：本资讯由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）整理撰写，资讯所引用信息均来自公开资料，我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。资讯所载观点、结论及意见仅代表分析师在报告发布时的个人判断，不代表工商银行立场，亦不构成任何投资与交易决策依据。对于任何因使用或信赖本资讯而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本资讯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。