

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年5月20日-5月24日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013年5月20日-5月24日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.21%，并于周五（5月24日）创 2005 年汇改以来新高，报 6.1867。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.17%，最高 6.1276，最低 6.1416，报收于 6.1316，波幅为 0.21%。全周市场交投清淡，日均波幅仅 47 个点，人民币汇率在区间上限附近窄幅波动。周一至周三，人民币中间价连续三日高开，市场上人民币看涨情绪较浓，美元卖压较重，人民币汇率呈震荡上涨态势。周四，受国际市场欧元大幅下跌影响，人民币汇率小幅回落；周五，人民币中间价再创汇改以来新高，盘中人民币汇率首度突破 6.13 元，客户购汇需求大量涌现，受此影响，人民币汇率在高开后呈现震荡下跌态势，最终收于 6.1316。
上周汇丰银行公布中国 PMI 数据预览值为 49.6，7 个月来首度跌破 50 关口，显示中国制造业活动放缓，经济增长速度有所放慢，在一定程度上减弱人民币升值预期。预计本周人民币将呈现区间整理走势，上方阻力位 6.1200，下方支撑位 6.1400。
- 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。

前周上涨 20 个点，最高 1130，最低 1005，报收于 1120，波幅为 11.36%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投较活跃，日均波幅 45 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 135 个点，最高 6.2460，最低 6.2075，报收于 6.2265，上周波幅为 0.62%。

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	较前周 (BP)	较上月 (BP)	较年初 (BP)
中间价	—	—	6.1867	-130	-517	-1030
银行间市场汇价	6.1416	6.1276	6.1316	-103	-465	-987
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	157	127	135	-10	17	2.5
2 个月期限	267.5	104	250	-20	42	12.5
3 个月期限	367.5	335	356	-4	47	6
6 个月期限	640	555	640	0	110	10
1 年期限	1130	1005	1120	20	190	-100

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	较前周 (BP)	较年初 (BP)	与境内价差 (BP)
1 个月期限	6.2067	6.1825	6.1850	-180	-1190	408
2 个月期限	6.2076	6.1810	6.1855	-185	-1215	312
3 个月期限	6.2073	6.1820	6.1865	-185	-1245	227
6 个月期限	6.2150	6.1860	6.1974	-166	-1176	49
1 年期限	6.2460	6.2075	6.2265	-135	-1025	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。