

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年5月27日-5月31日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013年5月27日-5月31日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.12%，并于周五(2013年5月31日)创 2005 年汇改以来新高，报 6.1796。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 0.05%，上周最高 6.1210，最低 6.1421，报收于 6.1345，波幅为 0.15%。全周市场交投活跃，日均波幅 93 个点，人民币汇率总体呈宽幅震荡态势，双向波动特征明显。上周前两个交易日，受客户结汇需求偏多影响，人民币汇率小幅上涨。后三个交易日，受客户大额购汇需求及离岸市场人民币汇率下跌影响，银行间外汇市场人民币汇率小幅下跌，市场多空分歧加大，日间宽幅震荡特征明显，波幅持续维持在 100 点以上；周五人民币汇率最低触及 6.1421，此点位也为近十五个交易日来的新低。根据外管局发布的《关于加强外汇资金流入管理有关问题的通知》的要求，预计各银行近期将在市场大量买入美元以补充综合头寸，市场对人民币升值预期明显减弱。预计本周人民币汇率将呈震荡下跌走势，上方阻力位 6.1250，下方支撑位 6.1500。
- 人民币外汇掉期汇率：1 年期美元对人民币外汇掉期点较前周

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。

上升 50 个点，上周最高 1248，最低 1060，报收于 1145，上周波幅为 7.95%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投比较活跃，日均波幅 89 个点，掉期点全周整体小幅上涨。

- 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）较上周上涨 335 个点，上周最高 6.2071，最低 6.2675，报收于 6.2590，上周波幅为 0.36%。

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	—	—	6.1796	-71	-412	-1101
银行间市场汇价	6.1210	6.1421	6.1345	29	-305	985
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	146	100	139	5	48	6.5
2 个月期限	265	220	254	5	70	-8.5
3 个月期限	370	320	353	5	80	3
6 个月期限	699	595	637	20	125	7
1 年期限	1248	1060	1145	50	270	676

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	6.1730	6.1900	6.1870	-110	-470	-1310
2 个月期限	6.1730	6.1960	6.1920	75	280	115
3 个月期限	6.1735	6.2010	6.1970	115	-240	-1140
6 个月期限	6.1800	6.2210	6.2160	-155	-445	-1220
1 年期限	6.2071	6.2675	6.2590	335	-230	700

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。