

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年6月3日-6月7日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013年6月3日-6月7日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.28%，并于周五（2013年6月7日）创 2005 年汇改以来新高，报 6.1620。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.02%，上周最高 6.1234，最低 6.1390，报收于 6.1335，波幅为 0.12%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 70 个点，双向波动特征明显，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距缩窄至 300 点左右。上周前三个交易日，市场多空双方分歧较大，但受客户结汇需求偏多影响，人民币汇率一度上涨至 6.1230 一线；后两个交易日，受离岸人民币汇率下跌及财务公司在境内大量购入美元影响，银行间外汇市场美元买盘偏强，人民币汇率回落至 6.1340 附近。近日海关公布数据显示，5 月中国进出口数据大幅逊于预期，引发投资者对中国经济基本面的担忧，加之市场普遍预计各银行短期内将在银行间外汇市场大量买入美元以补充综合头寸，近期市场看跌人民币情绪较浓。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。

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。

- 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上涨 22 个点，上周最高 1215，最低 1093，报收于 1175，波幅为 7.97%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投比较活跃，日均波幅 92 个点，各期限掉期点整体小幅上涨。
- 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）较前周下跌 20 个点，上周最高 6.2375，最低 6.2630，报收于 6.2570，上周波幅为 0.28%。

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	—	—	6.1620	-176	-396	-1277
银行间市场汇价	6.1234	6.1390	6.1335	-10	-82	-968
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	173	130	169	30	65	28
2 个月期限	300	238	289	35	80	2
3 个月期限	415	338	393	40	85	-23
6 个月期限	748	607	677	22	135	-18
1 年期限	1215	1093	1175	22	200	-150

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	6.1705	6.1890	6.1770	-100	-1270	-280
2 个月期限	6.1720	6.1950	6.1845	-75	-1225	-115
3 个月期限	6.1780	6.2000	6.1915	-55	-1195	-173
6 个月期限	6.1965	6.2200	6.2095	-65	-1055	-92
1 年期限	6.2375	6.2630	6.2570	-20	-720	-42

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。