

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 6 月 10 日-6 月 14 日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 6 月 10 日-6 月 14 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.02%，并于周五(2013 年 6 月 14 日)创 2005 年汇改以来新高，报 6.1607。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.04%，上周最高 6.1300，最低 6.1429，报收于 6.1308，波幅为 0.13%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 83 个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差缩窄至 240 点左右。上周仅两个交易日，受端午长假后客户集中结汇及离岸市场人民币汇率大幅上涨影响，银行间市场美元卖盘较重，人民币汇率呈现震荡走升态势，自 6.1400 附近上涨至 6.1300 一线。近日市场对人民币汇率未来走势的判断分歧较大，客户结汇需求形成的美元卖盘与各银行补充综合头寸形成的美元买盘并存，短期内人民币汇率出现大幅上涨或大幅下跌的可能性较小。预计本周人民币汇率将呈区间震荡走势，上方阻力位 6.1200，下方支撑位 6.1400。
- 人民币外汇掉期汇率：1 年期美元对人民币外汇掉期点较前周上涨 90 个点，上周最高 1325，最低 1158，报收于 1265，波幅

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。

为 10.15%。美元兑人民币外汇掉期市场交投活跃，日均波幅 123 个点，各期限掉期点整体上涨。

- 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	—	—	6.1607	-13	-390	-1290
银行间市场汇价	6.1300	6.1429	6.1308	-27	-111	-995
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	225	160	214	45	82	73
2 个月期限	375	285	354	65	105	67
3 个月期限	495	370	458	65	105	42
6 个月期限	805	650	757	80	140	62
1 年期限	1325	1158	1265	90	180	-60

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	6.1700	6.1800	6.1760	-10	-1280	-207
2 个月期限	6.1805	6.1910	6.1860	-15	-1210	-102
3 个月期限	6.1861	6.2030	6.1940	-25	-1170	-135
6 个月期限	6.2130	6.2320	6.2200	-95	-1150	-82
1 年期限	6.2630	6.2925	6.2730	160	-560	-97

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。