

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年6月17日-6月21日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013年6月17日-6月21日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周下跌 0.26%，银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 0.06%，上周最高 6.1236，最低 6.1359，报收于 6.1342，波幅为 0.19%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 70 个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距 400 点左右。上周首个交易日，离岸市场人民币汇率大幅上涨，带动银行间外汇市场美元卖盘偏多，人民币汇率上涨至 6.1250 一线；后四个交易日，市场交投谨慎，多空双方力量较为均衡，但受人民币中间价连续低开及客户购汇需求偏多影响，人民币汇率震荡下跌至 6.1330 附近。上周美联储发表声明称，若美国经济如预期继续改善，美联储将在今年晚些时候缩减购债计划，在此声明影响下，近日国际市场美元走势偏强，加之本周为各银行补充综合头寸截止期限，各方预期短期内银行间外汇市场美元买盘将偏多，市场看跌人民币情绪较浓。预计本周人民币汇率将下跌，上方阻力位 6.1350，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。

上涨 130 个点，上周最高 1620，最低 1210，报收于 1385，波幅为 10.24%。美元兑人民币外汇掉期市场交投活跃，日均波幅 143 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 240 个点，上周最高 6.2440，最低 6.3130，报收于 6.2970，上周波幅为 0.39%。

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	—	—	6.1766	159	-98	-1131
银行间市场汇价	6.1236	6.1359	6.1342	34	26	-961
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	370	197	279	65	145	138
2 个月期限	525	332	439	85	190	152
3 个月期限	720	445	568	110	220	152
6 个月期限	1050	725	867	110	250	172
1 年期限	1620	1210	1385	130	290	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	6.1680	6.2020	6.1980	22	-1060	-319
2 个月期限	6.2160	6.1770	6.2115	255	-955	-242
3 个月期限	6.1841	6.2265	6.2230	290	-880	-272
6 个月期限	6.2050	6.2550	6.2470	270	-680	-212
1 年期限	6.2440	6.3130	6.2970	240	-320	-203

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。