

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年6月24日-6月28日)

## ◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013年6月24日-6月28日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周下跌 0.03%，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 6.1347，最低 6.1520，报收于 6.1376，波幅为 0.28%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 81 个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距 340 点左右。上周前四个交易日，在近期国际市场美元强势及上周为各银行补充综合头寸的截止期限共同影响下，市场看跌人民币气氛较浓，美元买盘主导市场，人民币汇率自周一开盘的 6.1347 大幅下跌至 6.1500 一线；周五，市场预计各银行已基本完成综合头寸的补充，看跌人民币的预期有所减弱，受离岸人民币汇率大幅上涨及客户结汇盘涌现带动，人民币汇率全天呈震荡上涨态势，最终收于 6.1376，较上一日大涨 114 点。随着银行补充综合头寸形成的阶段性购汇需求结束，市场可能将重新回到结汇压力较大局面。预计本周人民币汇率将上涨，上方阻力位 6.1200，下方支撑位 6.1400。
- 人民币外汇掉期汇率：人民币兑美元外汇掉期市场交投活跃，

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。

随着货币市场资金面的改善，各期限掉期点整体下跌。1 年期人民币兑美元掉期点较前周下跌 205 个点，上周最高 1410，最低 1125，报收于 1160，波幅为 20.88%。

- 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 90 个点，上周最高 6.2830，最低 6.3185，报收于 6.2880，上周波幅为 0.56%。

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	—	—	6.1787	21	-9	-1110
银行间市场汇价	6.1347	6.1520	6.1376	34	31	-927
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	280	160	165	-114	26	24
2 个月期限	440	280	290	-149	36	3
3 个月期限	580	420	435	-133	82	19
6 个月期限	910	648	678	-190	78	-18
1 年期限	1410	1125	1160	-205	120	-165

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	6.1870	6.2110	6.1900	-80	-1140	-350
2 个月期限	6.1990	6.2280	6.2020	-95	-1050	-335
3 个月期限	6.2180	6.2390	6.2130	-100	-980	-300
6 个月期限	6.2340	6.2650	6.2370	-100	-780	-320
1 年期限	6.2830	6.3185	6.2880	-90	-410	-345

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。