

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 8 月 5 日-8 月 9 日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 8 月 5 日-8 月 9 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.24%，银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.1%，上周最高 6.1143，最低 6.1275，报收于 6.1230，波幅为 0.22%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 52 个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距 500 点左右。上周前三个交易日，市场交投平稳，在人民币中间价逐日高开及离岸人民币汇率走升的带动下，人民币汇率自 6.1260 附近震荡上涨至 6.1190 一线；后两个交易日，人民币汇率宽幅震荡，市场日间波幅明显增大，在中国超预期经济数据的指引下，人民币汇率一度走升至 6.1143，创汇改以来新高，但在此点位附近有较强阻力，最终人民币汇率在大量购汇客盘的推动下收于 6.1230。上周公布的中国 7 月份规模以上企业工业增加值大幅超出预期，与此前出炉的官方 PMI 及进出口数据一起，传递出中国经济企稳的信号，加上近期国际市场美元指数的连续下挫，银行间外汇市场美元卖压较重，但当人民币汇率触及 6.1200 以下有较强的美元买盘支撑，市场供需总体平衡的态势暂时未打破。预期人民

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。

币汇率本周仍延续区间震荡走势，上方阻力位 6.1100，下方支撑位 6.1300。

- 人民币外汇掉期汇率：美元兑人民币外汇掉期市场交投活跃，受人民币资金面趋于宽松带动，各期限掉期点全线下跌。1 年期美元对人民币外汇掉期点较前周下跌 90 个点，上周最高 1155，最低 1055，报收于 1070，波幅为 8.62%。
- 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 335 个点，上周最高 6.2920，最低 6.2510，报收于 6.2555，上周波幅为 0.65%。

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	—	—	6.1668	-149	37	-1229
银行间市场汇价	6.1143	6.1275	6.1230	-64	-145	-1073
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	153	110	110	-27	-22	-23
2 个月期限	275	232	235	-42	-27	-28
3 个月期限	385	335	335	-49	-69	-15
6 个月期限	675	615	615	-65	-75	-15
1 年期限	1155	1055	1070	-90	-135	-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	6.1700	6.1870	6.1745	-115	-1295	-385
2 个月期限	6.1760	6.1975	6.1815	-125	-1255	-322
3 个月期限	6.1830	6.2065	6.1875	-150	-1235	-271
6 个月期限	6.2055	6.2330	6.2115	-215	-1035	-228
1 年期限	6.2510	6.2920	6.2555	-335	-735	-268

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。