

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年8月12日-8月16日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨2个点，银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨0.13%，上周最高6.1090，最低6.1249，报收于6.1150，波幅为0.26%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅48个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距510点左右。上周前三个交易日，国际市场美元震荡走强，人民币中间价回调至6.1700一线，受此影响，人民币汇率自6.1196小幅下跌至6.1220附近；后两个交易日，人民币汇率日间波幅增大，在离岸人民币汇率大幅走强的带动下，银行间外汇市场美元卖盘明显占据上风，人民币汇率一度走升至6.1090，创汇改以来新高，但在此点位附近阻力较强，有大量购汇客盘涌现，最终人民币汇率在购汇客盘的推动下快速回落，最终收于6.1150。上周受客户结汇盘带动的银行间外汇市场美元卖压较重，但当人民币汇率触及6.1100以下时出现了较强的美元买盘支撑。预期人民币汇率本周将延续区间震荡走势，上方阻力位6.1050，下方支撑位6.1250。

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：美元兑人民币外汇掉期市场交投活跃受人民币资金面继续宽松，各期限掉期点小幅下跌。1 年期美元对人民币外汇掉期点较前周下跌 45 个点，上周最高 1070，最低 1025，报收于 1025，波幅为 9.35%。
- 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 95 个点，上周最高 6.2655，最低 6.2350，报收于 6.2460，上周波幅为 0.49%。

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	—	—	6.1666	-2	-85	-1231
银行间市场汇价	6.1090	6.1249	6.1150	-80	-229	-1153
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	140	116	123	13	-12	-10
2 个月期限	265	236	236	1	-24	-27
3 个月期限	380	323	330	-5	-45	-20
6 个月期限	670	600	610	-5	-48	-20
1 年期限	1125	1025	1025	-45	-105	-195

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	6.1805	6.1695	-50	-1345	-424
2 个月期限	6.1720	6.1882	6.1735	-80	-1335	-378
3 个月期限	6.1770	6.1960	6.1790	-85	-1320	-314
6 个月期限	6.1960	6.2192	6.1970	-145	-1180	-214
1 年期限	6.2350	6.2655	6.2460	-95	-830	-200

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。