

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013年8月19日-8月23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下跌 0.07%，银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 0.1%，上周最高 6.1134，最低 6.1272，报收于 6.1210，波幅为 0.23%。全周市场交投活跃，人民币汇率日均波幅 65 个点，日间人民币汇率交易区间与人民币中间价差距 470 点左右。上周首个交易日，受人民币中间价低开及离岸人民币大幅走跌带动，人民币汇率自 6.1140 震荡下跌至 6.1240 一线；后四个交易日，在汇丰 8 月份中国 PMI 初值数据超预期向好以及美联储 9 月份将缩减购债规模预期增强的双重影响下，市场对人民币汇率未来走势分歧加大，银行间外汇市场无明确方向，买卖力量大体均衡，人民币汇率在 6.1200 至 6.1260 宽幅震荡，最终收于 6.1210。近期银行间外汇市场买卖力量较均衡，预期本周人民币汇率将延续区间震荡态势，上方阻力位 6.1150，下方支撑位 6.1250。
- 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，受大量结汇客盘带动，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 45 个点，上周最高 1075，最低

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。

980，报收于 980，波幅为 9.32%。

- 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 70 个点，上周最高 6.2359，最低 6.2590，报收于 6.2390，上周波幅为 0.37%。

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	—	—	6.1710	44	-10	-1187
银行间市场汇价	6.1134	6.1272	6.1210	60	-106	-1093
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	134	108	108	-15	-41	-25
2 个月期限	260	219	219	-17	-61	-44
3 个月期限	360	305	305	-25	-95	-45
6 个月期限	680	578	578	-32	-92	-52
1 年期限	1075	980	980	-45	-161	-240

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	6.1665	6.1790	6.1685	-10	-1355	-365
2 个月期限	6.1679	6.1855	6.1710	-25	-1360	-288
3 个月期限	6.1719	6.1920	6.1750	-40	-1350	-229
6 个月期限	6.1914	6.2130	6.1945	-25	-1205	-155
1 年期限	6.2359	6.2590	6.2390	-70	-900	-190

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。