

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 5 月 13 日-5 月 17 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 0.03%，周五，人民币中间价报 6.1997，再次上涨至 6.2000 下方，较前周上涨 19 个点。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 0.003%，最高 6.1388，最低 6.1515，报收于 6.1419，波幅为 0.21%。全周市场交投较为清淡，日均波幅仅 36 个点，人民币汇率始终在区间上限附近窄幅波动。在人民币中间价先跌后涨的带动下，银行间外汇市场人民币汇率也先跌后涨。周一，人民币对美元交易汇率延续前周下跌趋势，一度下跌至 6.1500 附近。周二，在人民币中间价上涨的带动下，人民币对美元交易汇率上涨并在盘中触及涨停位置。周三至周五，市场交投较为清淡，人民币对美元汇率始终在涨停价位置附近盘整。在 4 月银行代客结售汇和远期结售汇签约仍然保持双顺差的情况下，短期内人民币升值压力难以消退。预计本周人民币将会延续上周升值趋势，上方阻力位 6.1300，下方支撑位 6.1500。
- 人民币外汇掉期汇率：上周 1 年期美元对人民币外汇掉期点较前周上涨 105 个点，最高 1120，最低 995，报收于 1100，波

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。

幅为 12.56%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投较活跃，日均波幅 29 个点，掉期点全周整体变动不大，呈区间震荡态势。

- 境外人民币无本金交割（NDF）远期汇率：上周 1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上涨 150 个点，最高 6.2445，最低 6.2150，报收于 6.2360，上周波幅为 0.47%。

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	—	—	6.1997	-19	-345	-900
银行间市场汇价	6.1515	6.1388	6.1419	2	-304	-884
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	150	117	145	38	59	12.5
2 个月期限	270	106	270	55	99	7.5
3 个月期限	338.75	324	360	43	100	10
6 个月期限	650	560	640	85	144	10
1 年期限	1120	995	1100	105	204	-120

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	6.2110	6.1940	6.2030	10	-1010	408
2 个月期限	6.2150	6.1940	6.2030	10	-1040	312
3 个月期限	6.2180	6.1945	6.2040	20	-1070	227
6 个月期限	6.2240	6.1975	6.2140	120	-1010	49
1 年期限	6.2445	6.2150	6.2360	150	-930	233

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。