

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 7 月 15 日-7 月 19 日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 7 月 15 日-7 月 19 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周下跌 0.19%，报 6.1751。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 0.007%，最高 6.1308，最低 6.1420，报收于 6.1379，波幅为 0.18%。上周一，国家统计局公布二季度国内生产总值（GDP）同比增长 7.5%，符合市场预期，并未给人民币汇率走势带来方向性指引，上周前三个交易日，银行间外汇市场观望情绪浓厚，交投较为清淡，人民币汇率在 6.1308 至 6.1397 区间内窄幅波动。上周四，虽然伯南克在参议院金融服务委员会上的证词表述如预期和前期表态一致，隔夜美元指数变化不大，但人民币中间价却意外低开，推动人民币对美元汇率小幅下跌至 6.1420 一线。上周五，在境外市场人民币汇率走升的带动下，境内市场人民币汇率亦小幅上涨。预计本周银行间外汇市场人民币汇率依旧缺乏方向性指引，人民币汇率将会延续上周区间震荡态势，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下跌 75 个点，最高 1195，最低 1070，报收于 1130，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 10.37%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投较活跃，日均波幅 39 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）较前周下跌 80 个点，最高 6.2890，最低 6.2640，报收于 6.2770，上周波幅为 0.4%。

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	—	—	6.1751	120	74	-1146
银行间市场汇价	6.1420	6.1308	6.1379	4	110	-924
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	143	76	135	3	-170	2.5
2 个月期限	285.5	240	260	-3	-200	-2.5
3 个月期限	415.5	125	375	-29	-223	25
6 个月期限	690	490	658	-32	-242	28
1 年期限	1195	1070	1130	-75	-320	-90

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	6.1920	6.1770	6.1880	10	-1160	332
2 个月期限	6.2055	6.1895	6.2005	-15	-1065	332
3 个月期限	6.2155	6.1985	6.2100	-10	-1010	32
6 个月期限	6.2410	6.2210	6.2340	-20	-810	27
1 年期限	6.2890	6.2640	6.2770	-80	-520	217

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。