

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2013 年 7 月 22 日-7 月 26 日)

◆ 人民币汇率市场上周概览 (2013 年 7 月 22 日-7 月 26 日)

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价较前周上涨 0.05%，报 6.1720。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周上涨 0.10%，最高 6.1294，最低 6.1421，报收于 6.1316，波幅为 0.21%。
上周，最新发布的汇丰制造业采购经理人指数（PMI）初值降至 47.4，为近 11 个月内的最低水平，显示我国经济增长乏力，但由于美国公布的成屋销售数据意外下降，支撑了对美国货币刺激举措将维持更长时间的预期，带动美元指数大幅走跌，银行间外汇市场美元卖压偏重，人民币汇率小幅升值，但仍然在 6.1300-6.1400 的区间内盘整。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 6.1250，下方支撑位 6.1450。
- 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 11 个点，最高 1180，最低 1125，报收于 1141，波幅为 4.87%。美元兑人民币外汇掉期市场整体交投清淡，日均波幅仅 23 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

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。

元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下跌 25 个点，最高 6.2830，最低 6.2665，报收于 6.2745，上周波幅为 0.26%。

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	—	—	6.1720	-31	-59	-1177
银行间市场汇价	6.1421	6.1294	6.1316	-64	-154	-987
掉期汇率点 (BP)						
1 个月期限	167	125	148.5	13.5	-61.5	16
2 个月期限	297	250	280	20	-80	17.5
3 个月期限	425	383	400	25	-85	50
6 个月期限	700	650	670	12	-95	40
1 年期限	1180	1125	1141	11	-79	-79

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	6.1900	6.1780	6.1840	-40	-1200	376
2 个月期限	6.2020	6.1900	6.1950	-55	-1120	356
3 个月期限	6.2108	6.1985	6.2050	-50	-1060	334
6 个月期限	6.2365	6.2240	6.2285	-55	-865	299
1 年期限	6.2830	6.2665	6.2745	-25	-545	289

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。