

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2015 年 6 月 15 日-6 月 19 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 63 个点，上周五（6 月 19 日）报 6.1104。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周下跌 14 个点，上周最高 6.2060、最低 6.2180，收于 6.2095，波幅为 0.19%。其中，上周前三个交易日，由于人民币汇率缺乏明确性方向指引，市场美元买卖力量较为均衡，人民币汇率主要于 6.2060 至 6.2090 区间内窄幅波动；上周四（6 月 18 日），尽管国际市场美元下跌，但是美元需求逐渐涌现带动各交易商倾向买入美元情绪较为浓厚，人民币汇率仍延续此前 6.2060 至 6.2090 区间的震荡行情；上周五，银行间美元买盘需求持续上升，汇价一度突破 6.21，市场流动性变差，交易商做多美元意愿被点燃，人民币汇率快速下跌，逼近 6.2180 一线，尾盘人民币汇率有所上涨，重新回到 6.21 下方，最终收于 6.2095。近期人民币汇率贬值预期重燃，预计本周将呈现震荡偏贬值的态势，阻力位 6.2000，支撑位 6.2200。
- 人民币外汇掉期汇率：市场交投较为活跃，掉期价格整体呈现震荡上行的态势，整条掉期曲线较前周小幅收高。短期限价格

缓慢上行，其他期限受到带动，亦小幅上移。上周前三个交易

免责声明：本资讯由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）整理撰写，资讯所引用信息均来自公开资料，我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。资讯所载观点、结论及意见仅代表分析师在报告发布时的个人判断，不代表工商银行立场，亦不构成任何投资与交易决策依据。对于任何因使用或信赖本资讯而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本资讯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。

日，掉期市场整体走势平稳，供需双方力量均衡，价格变动不大；上周后两个交易日，各期限价格高开高走。截至收盘，1年期限美元对人民币掉期点较前周上涨 120 个点，上周最高 1370、最低 1255，收于 1370，波幅为 9.16%。

- 境外人民币无本金交割远期（NDF）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 103 个点，上周最高 6.2575、最低 6.2355，收于 6.2387，波幅为 0.35%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末(点)	较去年末 (点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.1104	-63	-92	-86
银行间市场汇价	6.2180	6.2060	6.2095	14	110	55
掉期点						
1 个月期限	135	95	120	15	0	-120
2 个月期限	250	202	241.30	24.30	11.30	-193.70
3 个月期限	355	305	350	20	10	-275
6 个月期限	700	622	685	50	-15	-325
1 年期限	1370	1255	1370	120	-65	-215

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）汇率变动

	最高价	最低价	收盘 价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价差 (点)
1 个月期限	6.1300	6.1175	6.1187	-96	-363	-1028
2 个月期限	6.1420	6.1280	6.1295	-105	-460	-1041.30
3 个月期限	6.1540	6.1390	6.1395	-125	-630	-1050
6 个月期限	6.1875	6.1695	6.1722	-111	-848	-1053
1 年期限	6.2575	6.2355	6.2387	-103	-988	-1078

数据来源：路透

免责声明：本资讯由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）整理撰写，资讯所引用信息均来自公开资料，我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。资讯所载观点、结论及意见仅代表分析师在报告发布时的个人判断，不代表工商银行立场，亦不构成任何投资与交易决策依据。对于任何因使用或信赖本资讯而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本资讯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。