

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2017年11月13日-11月17日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.77%，上周最高 94.641、最低 93.402，收于 93.662。美元指数上周呈震荡走势。上周一(11月13日)，受美国国债收益率前周劲涨的支撑，且费城联储总裁哈克赞成美联储 12 月加息等因素影响，美元指数上涨；上周二(11月14日)，欧元区三季度经济成长强于美国，打压美元指数下跌；上周三(11月15日)，10 月美国基础通胀攀升，零售销售意外增长，巩固了对美联储将在 12 月加息的预期，美元兑一篮子主要货币削减跌幅；上周四(11月16日)，美国众议院通过众院版本的税改议案，且美国 10 月工业生产创六个月以来最大增幅，美元指数上涨；上周五(11月17日)，特朗普上任一年来各项政策提案均在国会折戟沉沙，投资者担忧美国共和党通过税改议案的努力是否能获得成功，美元指数下跌，最终收于 93.662。预计本周阻力位 94.901，支撑位 92.423。
- 欧元兑美元较前周上涨 1.11%，上周最高 1.1860、最低 1.1636，收于 1.1793。欧元兑美元上周呈震荡走势。上周一，因投资者担忧英国首相特雷莎梅是否有能力留任，以及是否能达成市

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。

场认为良好的退欧协议，欧元兑美元上涨；上周二，数据显示三季度德国经济加速增长，欧元兑美元急升至两周半以来高位；上周三，因市场巩固美联储年内加息预期，欧元兑美元下跌；上周四，受美元指数有所回升影响，欧元兑美元下跌；上周五，欧元区9月经常账户盈余扩大，受贸易顺差增长提振，带动欧元兑美元上涨，最终收于1.1793。预计本周阻力位1.2017，支撑位1.1569。

- 美元兑日元较前周下跌1.29%，上周最高113.91、最低111.93，收于112.07。美元兑日元上周呈现震荡下行走势。上周一，美元兑日元走势持稳，未见明显方向；上周随后两个交易日，日本三季度GDP环比年率上升1.4%，创逾10年以来最长连增期，稳健前景可期，且美元指数受税改前景不确定性的打压，美元兑日元小幅下跌；上周四，美国通胀及零售数据良好，提升了市场对美联储12月的加息预期，美元兑日元上涨；上周五，投资者仍忧虑美国共和党通过税改议案的努力是否能获得成功，美元兑日元下跌，最终收于112.07。预计本周阻力位114.05，支撑位110.09。

- 澳元兑美元较前周下跌1.25%，上周最高0.7668、最低0.7533，收于0.7565。澳元兑美元上周呈震荡走势。上周一，因澳元与美元收益率之差收窄至2001年以来最小，澳元兑美元下跌；上周二，受美元指数走强影响，澳元兑美元脱离低位有所回升；

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。

上周三，疲弱薪资数据令市场和澳洲央行感到意外，预示薪资环境继续低迷，澳元兑美元下跌；上周四，因基本乐观的就业报告触发一轮空头回补，澳元兑美元从近五个月以来低点反弹；上周五，因澳新两国国债与美国国债收益率之差收窄至逾十七年以来低点，从而削弱了澳新货币作为利差交易融资货币的吸引力，澳元兑美元下跌，最终收于 0.7565。预计本周阻力位 0.7700，支撑位 0.7430。

表 1：国际外汇市场主要货币汇率变动

主要货币汇率	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
美元指数	93.662	-0.77%	-0.94%
欧元/美元	1.1793	1.11%	1.28%
美元/日元	112.07	-1.29%	-1.36%
澳元/美元	0.7565	-1.25%	-1.18%

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。