

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2015 年 10 月 19 日-10 月 23 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 2.74%，上周最高 97.201、最低 94.552，收于 97.127。美元指数上周呈现震荡上涨的走势。上周前三个交易日，市场静待欧央行货币政策会议，投资者预期欧央行或将出台更多刺激措施扶助经济，但在会议前较为谨慎，美元指数自 94.55 附近小幅上扬至 95 一线。上周四（10 月 22 日），欧央行行长德拉吉表示，欧央行正在研究新的刺激措施并可能最早在 12 月推出，且如有需要将进一步下调已经为负的存款利率，以应对物价下跌，此番言论打压欧元，提振美元指数上涨。上周五（10 月 23 日），中国央行宣布“双降”，提振美股，美元指数继续上行，最高触及 97.201 的十周高位，收于 97.127。预计本周阻力位 98.000，支撑位 95.000。
- 欧元兑美元较前周下跌 2.93%，上周最高 1.1386、最低 1.0993，收于 1.1014。欧元兑美元上周呈现震荡下跌的走势。上周前三个交易日，市场静待欧央行货币政策会议，投资者持谨慎态度，欧元兑美元持稳于 1.1350 附近。上周四，欧央行行长德拉吉表示正在研究新的刺激措施以提振欧元区经济，并可能最

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。

早在 12 月推出，此番言论令欧元承压，欧元兑美元跳水至 1.11 一线。上周五，中国央行宣布“双降”，美元走强，继续打压欧元，欧元兑美元最低触及 1.0993 的十周低位，收于 1.1014。预计本周阻力位 1.1200，支撑位 1.0800。

- 美元兑日元较前周上涨 1.70%，上周最高 121.48、最低 119.12，收于 121.45。上周美元兑日元呈现震荡上涨的走势。上周前三个交易日，日本 9 月出口同比增速大幅放缓，令日本央行进一步放宽货币政策的压力有所增加，日元承压，美元兑日元自 119.10 附近震荡上行至 120 一线。上周四，欧央行行长德拉吉表示欧央行将采取进一步刺激措施以提振经济，促使美元上涨，美元兑日元走强。上周五，中国央行宣布“双降”，市场避险情绪有所缓解，日元继续遭到抛售，美元兑日元最高触及 121.48 的两个半月高位，收于 121.45。预计本周阻力位 123.00，支撑位 119.00。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.62%，上周最高 0.7307、最低 0.7180，收于 0.7212。上周澳元兑美元呈现震荡下跌的走势。上周前两个交易日，澳元兑美元持稳在 0.7250 附近，澳联储公布 10 月会议纪要维持利率不变，且中国第三季 GDP 增速略好于预期，对澳元汇率形成一定支撑。上周三（10 月 21 日），澳元兑美元走软至 0.7210 附近。上周四欧央行行长德拉吉暗示欧央行可能在 12 月份进一步放宽货币政策，上周五中国央行宣

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。

布“双降”，市场对美国 and 主要发达国家的货币政策背离的预期提振美元上涨，令非美货币整体承压，澳元兑美元收于 0.7212。预计本周阻力位 0.7350，支撑位 0.7100。

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	97.127	2.74%	0.81%
欧元/美元	1.1014	-2.93%	-1.45%
美元/日元	121.45	1.70%	1.34%
澳元/美元	0.7212	-0.62%	2.78%

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。