

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2015年11月23日-11月27日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.46%，上周最高 100.20、最低 99.312，收于 100.02。美元指数上周整体呈现震荡上涨走势。上周一（11月23日），受旧金山联储总裁威廉姆斯前周末发表对通胀立场异常强硬讲话的影响，市场对美联储 12 月加息的预期进一步升温，美元指数从开盘的 99.655 一路上行至 99.803，盘中触及 100 整数关口。上周二（11月24日），因美国消费者信心指数意外下滑和围绕俄罗斯-土耳其事件的全球紧张态势加剧，美元指数下跌至 99.50 一线。上周后三个交易日，因经济数据显示美国 10 月企业支出大幅上升且前周初请失业金人数下降，均支持美联储在 12 月加息，加之市场预期美元和欧洲主要货币的利差将日益扩大，诸多利多因素推动美元指数走强，美元指数攀升至 100 整数关口上方，盘中触及八个月高位。预计本周阻力位 101.000，支撑位 99.000。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.50%，上周最高 1.0689、最低 1.0565，收于 1.0590。欧元兑美元上周呈现宽幅震荡的走势。上周前两个交易日，美国公布 10 月成屋销售数据和 11 月消费者信心指数意外下滑，美元回软，欧元兑美元自 1.0645 附近震荡上

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。

涨、最高至 1.0673 一线。上周后三个交易日，美国公布 10 月制造业数据优于预期，巩固了市场对美联储将在 12 月加息的预期，提振美元；且投资者预期欧央行将在 12 月货币政策会议上采取进一步刺激举措，令欧元再度承压，欧元兑美元最低跌至 1.0565 的七个半月低位，最终收于 1.0590。预计本周阻力位 1.0700，支撑位 1.0300。

- 美元兑日元较前周下跌 0.06%，上周最高 123.25、最低 122.23，收于 122.82。上周美元兑日元呈窄幅震荡走势。上周前两个交易日，受美联储官员有关加息的鹰派言论、美国制造业与楼市数据疲弱、消费者信心指数意外下滑、以及俄罗斯-土耳其战机事件等因素影响，美元兑日元先从开盘的 122.77 上涨至 123.25 附近，后震荡下行、最低至 122.30 一线。上周后三个交易日，因市场预期美元和欧洲主要货币的利差将逐渐扩大，美元受到支撑，美元兑日元从 122.30 一线震荡上行至 122.80 附近。预计本周阻力位 125.50，支撑位 120.00。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.64%，上周最高 0.7283、最低 0.7157，收于 0.7192。上周澳元兑美元呈现宽幅震荡走势。上周前两个交易日，大宗商品价格持稳，市场风险情绪有所回升，令澳元汇率得到一定支撑，澳元兑美元自 0.7230 一线小幅走升至 0.7250 附近。上周后三个交易日，澳洲企业投资数据不佳，加之在美联储 12 月加息的市场预期持续升温的带动下，美元

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。

指数大幅上扬，澳元兑美元承压下行，走跌至 0.7190 附近企稳。预计本周阻力位 0.7350，支撑位 0.7050。

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	100.02	0.46%	3.17%
欧元/美元	1.0590	-0.50%	-3.77%
美元/日元	122.82	-0.06%	1.83%
澳元/美元	0.7192	-0.64%	0.77%

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。