

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 1 月 4 日-1 月 8 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.09%，上周最高 99.634、最低 98.049，收于 98.540。美元指数上周呈现窄幅震荡走势。上周一（1 月 4 日），受美联储加息的持续影响，美元指数走高。上周二（1 月 5 日），美国国债收益率和美股持稳，支撑美元走高，最高触及 99.634 的一个月高位。上周三（1 月 6 日），因美联储 2015 年 12 月货币政策会议纪要显示，基于对通胀可能长期保持在低位的担忧，美联储未来加息的步伐将是渐进的，美元指数从一个月高位回落。上周四（1 月 7 日），美元指数尾盘下挫近 1%，为近一个月最大单日跌幅。上周五（1 月 8 日），中国采取措施缓解股票市场震荡，且美国 2015 年 12 月非农就业数据强劲，但市场仍担心中国股市情况，美元指数涨幅受限。预计本周阻力位 100.000，支撑位 98.000。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.64%，上周最高 1.0946、最低 1.0709，收于 1.0929。欧元上周呈现窄幅震荡走势。上周一，受德国 2015 年 12 月通胀意外放缓影响，欧元兑美元小跌。上周二，欧元区 2015 年 12 月核心通胀率连续第二个月下跌，增强了市场对欧洲央行进一步加大货币刺激措施力度以避免通缩的预

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。

期，欧元兑美元继续走跌，最低触及 1.0709 的一个月低位。

上周后半周，标普 500 指数重挫逾 2%，迫使借入欧元购买股票的投资者回购欧元以出脱仓位，提振欧元兑美元至 1.0930 一线。预计本周阻力位 1.1000，支撑位 1.0700。

- 美元兑日元较前周下跌 2.38%，上周最高 120.45、最低 117.30，收于 117.44。美元兑日元上周呈现震荡下行走势。上周前三个交易日，在市场担忧全球经济增长放缓、中国股市持续下跌、伊朗和沙特局势紧张、以及朝鲜宣称成功进行核试验等因素的影响下，交易商通过低风险货币寻求资金安全，推动日元走强。上周后两个交易日，人民币进一步贬值及市场对中国经济放缓的担忧，令投资者纷纷寻求避险，美元兑日元最低跌至 117.30 的逾四个月最低。预计本周阻力位 120.00，支撑位 116.00。
- 澳元兑美元较前周下跌 4.45%，上周最高 0.7300、最低 0.6949，收于 0.6951。上周澳元兑美元呈现震荡下行走势。上周前四个交易日，投资者对中国经济增长前景的担忧加剧，促使投资者出脱澳元；加之大宗商品价格下跌，打压商品货币。上周五，美国非农就业数据公布后，澳元兑美元最低跌至 0.6949。预计本周阻力位 0.7300，支撑位 0.6900。

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	98.540	-0.09%	-0.09%
欧元/美元	1.0929	0.64%	0.64%
美元/日元	117.44	-2.38%	-2.38%
澳元/美元	0.6951	-4.45%	-4.45%

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。