

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016年3月28日-4月1日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 1.58%，上周最高 96.399、最低 94.319，收于 94.619。美元指数上周呈现震荡下跌走势。上周一（3月28日），因美国公布的数据显示通胀回落、消费者支出数据被下修，打压了市场对美联储可能加快升息步伐的预期，美元指数盘中小幅下跌；上周二（3月29日），美联储主席耶伦称在加息问题上仍宜“谨慎”行事，美元指数下跌，盘中触及近一周低点 95.089；随后两个交易日，交易商继续消化美联储主席耶伦的鸽派讲话，市场推后对美联储下次加息时间的预期，美元指数触及 2015 年 10 月以来低点 94.319；上周五（4月1日），美国公布的非农数据好于预期，但不足以改变市场对美联储缓慢加息的预期，美元指数持稳。预计本周阻力位 96.70，支撑位 92.54。
- 欧元兑美元较前周上涨 2.00%，上周最高 1.1437、最低 1.1151，收于 1.1386。欧元兑美元上周呈现震荡上扬走势。上周一，受美国公布弱于预期的通胀和消费数据影响，欧元兑美元盘中最高触及 1.1218；上周二，因美联储主席耶伦表态偏鸽派，

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。

欧元兑美元上涨近 1%、收于 1.1289，盘中升穿 1.13；后三个交易日，交易商继续消化美联储主席耶伦的鸽派讲话，盘中一度升穿 1.14，但在美国公布强于预期的就业数据后稍有回落，最终收于 1.1386。预计本周阻力位 1.1672，支撑位 1.1100。

- 美元兑日元较前周下跌 1.23%，上周最高 113.80、最低 111.56，收于 111.65。美元兑日元上周呈现震荡下跌走势。上周一，美国通胀等数据弱于预期，但美元兑日元仍上涨 0.35%；上周二，美联储主席耶伦发表鸽派讲话，市场推后对美联储下次加息时间的预期，美元兑日元下挫 0.66%至 112.68；随后两个交易日，美元兑日元窄幅波动，持稳于 112.50 一线；上周五，因交易商预计美联储将推迟加息，美元兑日元下跌、收于 111.65。预计本周阻力位 113.89，支撑位 109.41。
- 澳元兑美元较前周上涨 2.17%，上周最高 0.7721、最低 0.7490，收于 0.7668。澳元兑美元上周呈现宽幅震荡走势。上周一，美国差于预期的通胀等数据使得市场推后了对美联储加息时点的预期，澳元兑美元小幅上涨至 0.7543；上周二，美联储主席耶伦强调收紧货币政策需“谨慎”推进后，澳元兑美元升至 0.7625；随后两个交易日，受美联储鸽派立场、中国公布较为强劲的制造业 PMI 数据等影响，澳元兑美元一度触及 0.7721 的九个月高位，最终收于 0.7668。预计本周阻力位 0.7899，支撑位 0.7437。

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。

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	94.619	-1.58%	0.03%
欧元/美元	1.1386	2.00%	0.07%
美元/日元	111.65	-1.23%	-0.81%
澳元/美元	0.7668	2.17%	0.18%

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。