

# 工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 5 月 23 日-5 月 27 日)

## ◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.20%，上周最高 95.779、最低 94.329，收于 95.521。美元指数上周呈现震荡上涨走势。上周一（5 月 23 日），美元指数小幅走跌，收于 95.231；上周二（5 月 24 日），因对美联储未来数月内加息的预期增强，美元指数走高至 95.571；随后两个交易日，因押注美联储将很快加息的交易员锁定近期美元上涨带来的部分利润，以及美国企业支出计划疲弱降低了美联储 6 月或者 7 月加息的预期，美元指数有所回落；上周五（5 月 27 日），美联储主席耶伦讲话为未来数月加息敞开大门，进一步增强美联储加息预期，美元指数一度触及两个月高位，收于 95.521。预计本周美元指数阻力位 96.85，支撑位 94.60。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.96%，上周最高 1.1243、最低 1.1106，收于 1.1114。欧元兑美元上周呈现震荡下跌走势。上周一，因投资人静待美国公布经济数据，欧元兑美元变动不大；上周二，因市场对美联储未来数月内加息的预期增强，欧元兑美元一度触及近十周以来最低水平；随后两个交易日，因美国企业

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。

支出计划疲弱降低了美联储近期加息的预期，欧元兑美元有所回升；上周五，美联储主席耶伦讲话为未来数月加息敞开大门，进一步增强美联储加息预期，欧元兑美元一度触及 1.1110，的近 2 月最低水平，收于 1.1114。预计本周欧元兑美元阻力位 1.1391，支撑位 1.1003。

- 美元兑日元较前周上涨 0.07%，上周最高 110.45、最低 109.08，收于 110.22。美元兑日元上周呈现震荡上涨走势。上周一，因日本贸易数据及美国反对日本干预汇市，美元兑日元下跌，收于 109.22；随后三个交易日，美元兑日元在 110 附近震荡；上周五，美联储主席耶伦讲话为未来数月加息敞开大门，进一步增强美联储加息预期，美元兑日元上涨，收于 110.22。预计本周美元兑日元阻力位 113.59，支撑位 107.99。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.55%，上周最高 0.7259、最低 0.7142，收于 0.7179。澳元兑美元上周呈现震荡下跌走势。上周一，美元指数小幅走跌，澳元兑美元小幅上涨；上周二，因澳央行总裁史蒂文斯的言论助燃对澳央行将可能再次减息的预期，澳元兑美元下跌至 0.7182；随后两个交易日，因美国企业支出计划疲弱降低了美联储近期加息的预期，澳元兑美元有所回升；上周五，美联储主席耶伦讲话为未来数月加息敞开大门，进一步增强美联储加息预期，澳元兑美元下跌，收于 0.7179。

预计本周澳元兑美元阻力位 0.7412，支撑位 0.7026。

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   | 95.521 | 0.20%   | 2.62%    |
| 欧元/美元  | 1.1114 | -0.96%  | -2.97%   |
| 美元/日元  | 110.22 | 0.07%   | 3.64%    |
| 澳元/美元  | 0.7179 | -0.55%  | -5.56%   |

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。