

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016年7月18日-7月22日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.92%，上周最高 97.543、最低 96.466，收于 97.467。美元指数上周呈震荡上涨走势。上周一（7月18日），市场对土耳其政局动荡的担忧缓解，且缺乏重要数据指引，美元指数持稳于 96.50 一线；上周随后两个交易日，美国 6 月房屋开工数据好于预期，巩固了美国经济表现强劲的市场观点，投资者对美联储将会收紧货币政策的预期升温，美元兑一篮子货币盘中触及四个月高位；上周四（7月21日），美国 6 月成屋销售数据强劲且企业裁员处于低位，美元兑一篮子货币持平；上周五（7月22日），美国 7 月 Markit 制造业 PMI 初值为 52.9，好于市场预期，创 2015 年 10 月以来最高，美元指数上扬，收于 97.467。预计本周阻力位 98.540，支撑位 96.390。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.55%，上周最高 1.1085、最低 1.0951，收于 1.0973。欧元兑美元上周呈震荡下跌走势。上周前两个交易日，美国 6 月房屋开工增幅超预期，美联储年内加息的预期升温，欧元兑美元盘中跌穿 1.10，触及三周低位 1.0998；

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。

上周随后两个交易日，在欧央行召开货币政策会议前，欧元兑美元基本持稳；上周五，欧央行维持基准利率不变、美国 7 月制造业 PMI 数据强劲，欧元兑美元承压下行，并在慕尼黑发生枪击事件后扩大跌幅，收于 1.0973。预计本周阻力位 1.1107，支撑位 1.0839。

- 美元兑日元较前周上涨 1.17%，上周最高 107.47、最低 105.04，收于 106.06。美元兑日元上周呈震荡上涨走势。上周一，投资者出脱因土耳其军方人员企图发动政变带动的大规模避险交易，美元兑日元上涨逾 1%；上周二（7 月 19 日），美元兑日元在升穿 50 日移动均线后转升为跌；上周三（7 月 20 日），因市场风险意愿降温，美元兑避险货币日元走软；上周四，美国经济数据强劲，美联储年内收紧货币政策的预期升温，美元兑日元盘中升穿 107 关口；上周五，日本央行行长黑田东彦称没有必要通过“直升机撒钱”的方式来刺激经济，美元兑日元从高位下跌，收于 106.06。预计本周阻力位 110.71，支撑位 98.95。
- 澳元兑美元较前周下跌 1.53%，上周最高 0.7606、最低 0.7439，收于 0.7461。澳元兑美元上周呈下跌的走势。上周一，澳联储公布货币政策会议纪要前，投资者退场观望，澳元兑美元持稳；上周随后两个交易日，澳联储 7 月货币政策会议纪要显示保留宽松政策的可能性，澳元兑美元走软，并交投于 0.75 下

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。

方；上周四，澳元兑美元略有反弹，上涨 0.24%至 0.7495；上周五，投资者削减澳元多头头寸，押注即将公布的通胀数据或将促使澳洲降息，同时乐观的美国经济数据提振美元，澳元兑美元下跌，收于 0.7461。预计本周阻力位 0.7628，支撑位 0.7294。

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	97.467	0.92%	1.38%
欧元/美元	1.0973	-0.55%	-1.18%
美元/日元	106.06	1.17%	2.72%
澳元/美元	0.7461	-1.53%	0.15%

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。