

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016年8月8日-8月12日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.49%，上周最高 96.524、最低 95.254，收于 95.722。美元指数上周呈现震荡下行走势。上周一（8月8日），美元指数上涨，因此前发布的强于预期的美国7月就业报告提振了美联储更加接近加息的预期；随后两个交易日，美国第二季非农生产力环比年率意外下跌，显示生产率持续疲弱，投资人重新评估美联储今年加息的可能性，美元走软；上周四（8月11日），美元指数上涨，因旧金山联储总裁威廉姆斯表示，美联储今年应进一步加息，以反映就业市场状况改善和通胀正在上升的可能性；上周五（8月12日），美国公布的7月零售销售意外持平，且7月生产者物价指数(PPI)也下滑，市场预期为上涨，这令投资人愈发担心美国第三季经济成长强度，美元兑一篮子货币下滑，最终收于 95.722。预计本周美元指数阻力位 96.99，支撑位 94.45。

- 欧元兑美元较前周上涨 0.66%，上周最高 1.1221、最低 1.1067，收于 1.1158。欧元兑美元上周呈现震荡上涨走势。上周一，

欧元兑美元区间窄幅波动；随后两个交易日，第二季美国非农

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。

生产率下降令美元承压，投资人重新评估美联储今年加息的可能性，欧元兑美元录得连续两日上涨，收于 1.1170；上周四，欧元兑美元下跌 0.29%，因旧金山联储总裁威廉姆斯表示美联储在今年加息是恰当的；上周五，欧元兑美元短线上扬，因当日公布的美国 7 月零售数据远不及市场预期，但随后因强劲的消费者支出数据回吐涨幅，最终收于 1.1158。预计本周欧元兑美元阻力位 1.1312，支撑位 1.1004。

- 美元兑日元较前周下跌 0.50%，上周最高 102.65、最低 100.82，收于 101.29。美元兑日元上周呈现震荡下行走势。上周一，受助于此前公布的强劲就业数据影响，美元兑日元继续走强，收于 102.44；随后两个交易日，美元兑日元回吐前一交易日涨幅，因投资人谨慎评估美联储今年加息的可能性，且第二季美国非农生产率不及预期；上周四，美元兑日元在窄幅区间震荡，纽约尾盘小幅收高；上周五，美国 7 月零售数据不及预期且 7 月生产者物价指数也下滑，美元兑日元跌 0.77%，收于 101.29。预计本周美元兑日元阻力位 103.12，支撑位 99.46。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.35%，上周最高 0.7756、最低 0.7594，收于 0.7646。澳元兑美元上周呈现震荡上扬走势。上周前两个交易日，油价收涨近 3%，且对收益率的追求支撑了利差交易，澳元守住近期涨势，持于三周高位附近；上周三（8 月 10 日），高收益资产继续受到青睐，推动澳元升至三个月高点；

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。

上周四，新西兰央行一如预期进行降息，但降息力度不及市场预期，澳元连续第四个交易日上涨，收于 0.7710 上方；上周五，澳元脱离近期高点，回吐大部分本周涨幅，收于 0.7646。预计本周澳元兑美元阻力位 0.7808，支撑位 0.7484。

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	95.722	-0.49%	0.20%
欧元/美元	1.1158	0.66%	-0.11%
美元/日元	101.29	-0.50%	-0.74%
澳元/美元	0.7646	0.35%	0.67%

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。