

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 9 月 12 日-9 月 16 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.81%，上周最高 96.108，最低 94.935，收于 96.108。美元指数上周呈震荡上行走势。上周一（9 月 12 日），因此前美联储理事布雷纳德讲话立场偏鸽派，削弱了市场对本月美联储加息的预期，美元指数下跌。上周二（9 月 13 日），市场焦点转至美联储在 12 月加息的可能性，风险较大货币的下跌提振美元，美元指数上升。上周三（9 月 14 日），美联储货币政策前景的不确定性令美元兑其它货币承压，美元指数从高位下跌。上周四（9 月 15 日），疲弱的美国零售销售数据压低了市场对美联储下周加息的预期，美元指数小幅下跌。上周五（9 月 16 日），美国 8 月消费者物价指数强于预期，通胀数据提振市场对美联储 12 月加息预期，美元指数大幅上涨，收于 96.108。预计本周阻力位 97.28，支撑位 94.94。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.68%，上周最高 1.1283，最低 1.1145，收于 1.1153。欧元兑美元上周呈震荡下行走势。上周一，欧元兑美元小幅微升。上周二，受市场对美联储于 12 月加息预期及美元指数走强影响，欧元兑美元下跌。上周三，因德国国

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。

债收益率上涨抵消了美元走强的影响，欧元兑美元上涨。随后两个交易日，受美国 8 月消费者物价指数强于预期影响，美元指数触及近 15 日高位，欧元兑美元大幅下跌，收于 1.1153。预计本周阻力位 1.1291，支撑位 1.1015。

- 美元兑日元较前周下跌 0.39%，上周最高 103.34，最低 101.40，收于 102.28。美元兑日元上周呈震荡下行走势。上周一，部分国家股市下滑激发日元避险需求，同时此前美联储官员讲话立场偏鸽派，美元兑日元下跌。上周二，受市场对美联储于 12 月加息预期及美元指数走强影响，美元兑日元反弹。随后两个交易日，因投资者认为日央行货币政策刺激措施效应将有限，不相信日央行进一步追加货币政策刺激举措能大幅压低日元，另外获利回吐和商品货币上涨也抑制了美元，美元兑日元连续两日下跌。上周五，美元兑日元微幅上涨，收于 102.68。预计本周阻力位 104.22，支撑位 100.34。

- 澳元兑美元较前周下跌 0.66%，上周最高 0.7567，最低 0.7439，收于 0.7488。澳元兑美元上周呈震荡下行走势。上周一，在连续录得三个交易日下跌后，澳元兑美元持稳。上周二，交易商因担心全球多个央行已达政策刺激极限，纷纷解除高收益、风险较高的资产，重新调整投资组合，澳元兑美元大幅走低。上周三，因此前公布的澳洲就业数据喜忧参半，未能激励市场多头，澳元兑美元仍在低位徘徊。上周四，因疲弱的美国零售

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。

销售数据打压了市场对美联储 9 月加息预期，澳元兑美元上涨。上周五，受美元走强影响，澳元兑美元下跌，收于 0.7488。预计本周阻力位 0.7616，支撑位 0.7360。

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	96.108	0.81%	0.23%
欧元/美元	1.1153	-0.68%	0.22%
美元/日元	102.28	-0.39%	-7.59%
澳元/美元	0.7488	-0.66%	3.58%

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。