

# 工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 9 月 19 日-9 月 23 日)

## ◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.66%，上周最高 96.333、最低 95.048，收于 95.477。美元指数上周呈现震荡下行走势。上周一（9 月 19 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 月加息的预期，美元指数盘中一度站上 96 关口。上周二（9 月 20 日），因市场预期美联储立场温和，且预计日本央行不会令日元走软，美元指数小幅上扬。上周三（9 月 21 日），在日本央行和美联储货币政策会议结束前，市场交投清淡，美元指数下跌。上周四（9 月 22 日），美联储维持货币政策不变，市场预期未来加息力度将减弱，美元兑一篮子货币续跌，美元指数跌幅扩大。上周五（9 月 23 日），美联储下调长期利率预估，拖累美元兑一篮子货币全面下跌，美元指数一度跌至近 10 天以来最低水准，尾盘有所回升。预计本周阻力位 96.760，支撑位 94.190。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.62%，上周最高 1.1257、最低 1.1119，收于 1.1222。欧元兑美元上周呈现震荡上行走势。上周一，

德国股市 DAX 指数攀升，欧元兑美元小幅上升。上周二，市场

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。

焦点主要在于日本央行及美联储货币政策会议，欧元兑美元小幅下跌。上周三，市场预计美联储即便不加息也会持鹰派立场，欧元兑美元上涨。上周四，受欧元区9月消费者信心指数小幅攀升影响，欧元兑美元走强。上周五，欧元兑美元在相对乐观的欧元区采购经理人指数出炉后录得的温和涨幅，收于1.1222。预计本周阻力位1.1360，支撑位1.1084。

- 美元兑日元较前周下跌1.27%，上周最高102.78、最低100.07，收于100.98。美元兑日元上周呈现震荡下行走势。上周一，由于日本金融市场逢假日休市，交投清淡，美元兑日元下跌。上周二，投资者静待日本央行和美联储货币政策会议决议，并普遍预计日本央行将对宽松政策进行重大调整，美元兑日元仍在低位徘徊。上周三，美日货币政策会议结果存在的不确定性限制了走势，导致日元波动，美元兑日元下跌。上周四，投资者预计未来美联储加息步伐缓慢，美元兑日元一度跌至近四周低位而后反弹。上周五，美元兑日元微幅上涨，但仍录得周线下跌，收于100.98。预计本周阻力位103.69，支撑位98.27。

- 澳元兑美元较前周上涨1.74%，上周最高0.7675、最低0.7469，收于0.7618。澳元兑美元上周呈现震荡上涨走势。上周一，因市场对美联储加息的预期较低，美元走低带动澳元走高。上周随后两个交易日，此前澳联储货币政策会议纪要暗示政策前

景稳定，但市场交投却被即将到来的日本央行及美联储货币政

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。

策会议影响，澳元兑美元上涨。上周四，澳联储乐观预期经济前景，澳元兑美元一度走升至两周高位。上周五，受美元走强的影响，澳元兑美元微跌，收于 0.7618。预计本周阻力位 0.7824，支撑位 0.7412。

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   | 95.477 | -0.66% | -0.57%  |
| 欧元/美元  | 1.1222 | 0.62%  | 0.59%   |
| 美元/日元  | 100.98 | -1.27% | -2.36%  |
| 澳元/美元  | 0.7618 | 1.74%  | 1.38%   |

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。