

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 10 月 24 日-10 月 28 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.35%，上周最高 99.119、最低 98.242，收于 98.348。美元指数上周呈现震荡走势。上周一（10 月 24 日），美国芝加哥联储主席埃文斯预期明年底前美联储将加息三次，同时受投资者对美联储今年将加息的预期、共和党总统候选人特朗普赢得大选的可能性下降等因素支撑，美元指数徘徊在九个月高位附近。上周二（10 月 25 日），虽然美国公布的 8 月房价同比上涨 5.1%，但受 10 月消费者信心下滑的影响，美元指数小幅下跌。上周三（10 月 26 日），美国新屋销售增加且贸易逆差收窄，反映第三季 GDP 增长加速，但受投资者对美联储货币政策和美国大选担忧的情绪影响，美元指数继续下跌。上周四（10 月 27 日），美国 9 月企业支出疲弱，但其它经济数据表现较好，上周初请失业金人数下降、9 月成屋待完成销售指数反弹，美元指数上涨。上周五（10 月 28 日），FBI 局长透露将调查新发现的与希拉里使用私人服务器有关的邮件，增加美国总统大选的不确定性，受此影响，美元兑一篮子货币盘中急挫，最终收于 98.348。预计本周阻力位 99.230，

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。

支撑位 97.470。

- 欧元兑美元较前周上涨 0.93%，上周最高 1.0991、最低 1.0848，收于 1.0983。欧元兑美元上周呈现震荡上行走势。上周一，欧元区 10 月企业活动扩张速度创今年最快，价格涨幅为逾五年最大，但受投资者对美联储加息预期的影响，欧元兑美元小幅下跌。上周随后两个交易日，美国公布的 10 月消费者信心指数不及预期，同时受到不确定的美联储货币政策及美国大选结果影响，美元走弱支撑欧元兑美元上涨。上周四，欧央行几乎可以确定明年 3 月后会继续购债，放宽量化宽松 (QE) 规定，欧元兑美元走弱。上周五，FBI 调查希拉里邮件的事件增加了美国总统大选的不确定性，美元指数下挫，欧元兑美元上涨，最终收于 1.0983。预计本周阻力位 1.1126，支撑位 1.0840。
- 美元兑日元较前周上涨 0.86%，上周最高 105.53、最低 103.69，收于 104.69。美元兑日元上周呈现震荡上行走势。上周前四个交易日，美国近期良好的经济数据和美联储官员偏鹰派言论进一步提振投资者对美联储 12 月加息的预期，美元兑日元连续四个交易日上涨。上周五，美元指数受再查希拉里邮件的影响下挫，美元兑日元下跌，最终收于 104.69。预计本周阻力位 106.53，支撑位 102.85。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.09%，上周最高 0.7708，最低 0.7555，收于 0.7595。澳元兑美元呈震荡走势。上周前三个交易日，

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。

澳洲第三季消费物价涨幅大于预期，核心通胀率逾一年来首次上升，降低了澳联储近期降息的可能，澳元兑美元上涨。上周四，因美元在美国公布第三季 GDP 数据前走强，澳元兑美元受打压结束涨势，盘中触及两周低点。上周五，FBI 再查希拉里邮件令美元下挫，澳元兑美元走升，最终收于 0.7595。预计本周阻力位 0.7748，支撑位 0.7442。

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	98.348	-0.35%	3.02%
欧元/美元	1.0983	0.93%	-2.27%
美元/日元	104.69	0.86%	3.32%
澳元/美元	0.7595	-0.09%	-0.77%

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。