

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 12 月 5 日-12 月 9 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 101.74、最低 99.430，收于 101.59。美元指数上周呈现震荡走势。上周一（12 月 5 日），因投资者认为近期美元升势过度，进行获利了结，美元指数下跌。上周二（12 月 6 日），因市场对美国经济增长稳固的预期增加，美元指数小幅上涨。上周三（12 月 7 日），因美国国债收益率下滑，美元指数应声下跌。上周随后两个交易日，市场普遍预计美联储将在 12 月货币政策会议上进行今年首次加息，美元指数上涨，收于 101.59。预计本周阻力位 103.90，支撑位 99.280。
- 欧元兑美元较前周下跌 1.04%，上周最高 1.0872、最低 1.0503，收于 1.0559。欧元兑美元上周呈震荡下行走势。上周一，虽然意大利总理伦齐在修宪公投中失败，但市场已预计到此结果，欧元兑美元上涨。上周二，欧元兑美元重启跌势，市场认为这是上周一上涨后的盘整，并非受到基本面因素驱动。上周三，由于市场认为意大利政治似乎暂时避免出现最糟糕的情况，欧元兑美元上涨，投资者静待欧央行货币政策会议。上周

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。

随后两个交易日，由于欧央行货币政策会议决定削减每月购买资产规模，但延长购债计划期限至明年底，较市场预期多了三个月，欧元兑美元连续两个交易日下跌，收于 1.0559。预计本周阻力位 1.0928，支撑位 1.0190。

- 美元兑日元较前周上涨 1.60%，上周最高 115.36，最低 112.84，收于 115.36。美元兑日元上周呈震荡上行走势。上周一，跟随美元下跌走势，日元整体走势疲弱，美元兑日元上升。上周二，日本央行副行长称，日本央行并非将政策重心偏离于印钞速度，强调仍致力于兼用降息及资产购买作为重振经济的主要工具，美元兑日元延续涨势。上周三，因美债收益率疲软且买盘消退，美元兑日元小幅下跌。上周四，日本第三季经济增幅被大幅下修，因资本支出和库存双双萎缩，美元兑日元上升。上周五，受欧央行政策会议的影响，美元指数上涨令日元承压，美元兑日元上涨，收于 115.36。预计本周阻力位 117.88，支撑位 112.84。

- 澳元兑美元较前周下跌 0.12%，上周最高 0.7507，最低 0.7408，收于 0.7451。澳元兑美元上周呈震荡走势。上周前三个交易日，由于先前澳洲公布的经济数据令人失望，引发市场对澳洲四季度经济可能下滑的疑虑，澳元兑美元窄幅波动。上周四，因股市上涨提振市场风险偏好，且受中国对澳洲主要出口资源需求的支撑，澳元兑美元盘中一度回升，但收盘小幅收跌。上

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。

周五，欧央行货币政策大力压低短债收益率，欧元占主导致使澳元走势平淡，澳元兑美元小幅收跌，收于 0.7451。预计本周阻力位 0.7550，支撑位 0.7352。

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	101.59	0.81%	0.09%
欧元/美元	1.0559	-1.04%	-0.25%
美元/日元	115.36	1.60%	0.80%
澳元/美元	0.7451	-0.12%	0.93%

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。