

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 10 月 10 日-10 月 14 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 1.44%，上周最高 98.129、最低 96.458，收于 98.019。美元指数上周呈现震荡上行走势。上周前三个交易日，因此前一系列美国经济数据总体稳健，投资者对美联储 12 月加息的预期升温，美元指数一度触及近七个月高位。上周四（10 月 13 日），因风险意愿回落，且中国贸易数据疲弱令预期美联储在年底前加息的投资者感到不安，美元指数自高位回落。上周五（10 月 14 日），美国公布了强劲的 9 月零售销售和生产者物价数据，巩固了投资者对美联储将在 12 月加息的预期；但美联储主席耶伦表示，美联储可能需要实施高压政策，才能使经济从危机中复苏，讲话发表后，美元对日元和欧元一度缩减涨幅，美元指数最终收于 98.019。预计本周阻力位 99.69，支撑位 96.35。
- 欧元兑美元较前周下跌 2.05%，上周最高 1.1201、最低 1.0966，收于 1.0969。欧元兑美元上周呈现震荡下行走势。上周前三个交易日，受英镑持续下跌和美国经济数据向好的影响，欧元兑美元持续下跌。上周四，因市场风险意愿回落，且中国贸易

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。

数据疲弱令预期美联储在年底前加息的投资者感到不安，美元指数高位回落，欧元兑美元有所反弹。上周五，美国公布了强劲的 9 月零售销售和生产者物价数据，巩固了投资者对美联储将在 12 月加息的预期，欧元兑美元走弱，最终收于 1.0969。预计本周阻力位 1.1204，支撑位 1.0734。

- 美元兑日元较前周上涨 1.24%，上周最高 104.62、最低 102.78 收于 104.18。美元兑日元上周呈现震荡上行走势。上周前两个交易日，因美国经济数据总体稳健，投资者对美联储 12 月加息的预期升温，但英镑持续下跌推升市场避险情绪，美元兑日元基本持稳。上周后三个交易日，因美国经济数据向好，市场对美联储年内加息的预期进一步上升，美元兑日元整体走升，最终收于 104.18。预计本周阻力位 106.02，支撑位 102.34。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.48%，上周最高 0.7647、最低 0.7504，收于 0.7611。澳元兑美元上周呈现震荡上升走势。上周一，澳元兑美元脱离两周低位，但市场交投较为清淡。上周二，因市场对美联储年内加息的预期升温，澳元兑美元小幅走弱。上周后三个交易日，受大宗商品价格上涨的带动，澳元兑美元持续小幅走升，最终收于 0.7611。预计本周阻力位 0.7754，支撑位 0.7468。

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	98.019	1.44%	2.68%
欧元/美元	1.0969	-2.05%	-2.39%
美元/日元	104.18	1.24%	2.81%
澳元/美元	0.7611	0.48%	-0.56%

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。