

工行金融市场：外汇汇率市场上周概览

(2013 年 6 月 17 日-6 月 21 日)

◆ 外汇汇率市场上周概览 (2013 年 6 月 17 日-6 月 21 日)

- 美元指数上周上涨 2.22 %，收报 82.41，最高上探 82.52，最低下探 80.50。伯南克在上周新闻发布会上的言论令其意图更为清晰，即确认如果经济继续围绕目前水平改善，并沿着向好的轨迹，美联储很可能开始减少购债。此消息一出，全球金融市场随即迎来大地震，各大金融市场犹如天灾降临，仅有美元“万绿丛中一点红”，录得近一年最佳周表现。本周需要关注美国经济数据的情况，若美国经济数据能持续改善，那么无疑将继续助涨美元，非美货币将持续承压，反之，可能会限制美元的涨幅。本周主要关注费舍尔和鲍威尔等美联储官员关于货币政策的讲话，美国经济数据方面关注 5 月新屋销售月率和第一季度 GDP 年率终值的变化情形。阻力位 83，支撑位 81.5。
- 欧元兑美元上周下跌 1.69 %，收报 1.3122，最高上探 1.3417，最低下探 1.3099。因欧美利差朝有利于美元的方向变化，且希腊再度出现政治动荡。上周欧元兑美元出现自 2 月初以来的最大单周跌幅。上周希腊重回市场焦点，IMF 威胁称若欧元区不填补对希腊援助贷款中 30-40 亿欧元的资金缺口将不对希

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。

腊发放下笔援助贷款，导致希腊 10 年期国债收益率飙升 50 基点，政治风险小幅升温或加重欧元短期下行压力。本周德国将公布 IFO 商业景气指数、实际零售销售、GfK 消费者信心指数以及季调后失业人数，若数据整体向好，料将提振欧元。此外本周还需关注众多美国经济数据和美联储官员讲话，若数据整体向好同时联储官员鹰派阵营占优势，则将提振美元，打压欧元。阻力位 1.32，支撑位 1.29。

- 美元兑日元上周上涨 3.81%，收报 97.90，最高上探 98.29，最低下探 94.09。美元/日元上周汇价连续 5 天上涨，日元疲软态势或重返。美联储 (Fed) 主席伯南克 (Ben Bernanke) 表示，如果经济预估符合预期，美国联邦公开市场委员会 (FOMC) 预计可能在今年减缓购债步伐，明年年中前将结束购买资产。而日本央行 (BOJ) 行长黑田东彦 (Haruhiko Kuroda) 表示，为抗击通货紧缩而在 4 月份推出的大规模宽松措施才刚刚开始，现在讨论退出该政策还为时过早。因此，美元/日元上行走势或将延续。市场预计一旦美国第二季度的上市公司收益季结束，且美国经济指标的改善从 7 月开始得到证实，那么美元或将持续走强，日元则可能继续走软。阻力位 99.5，支撑位 95。
- 澳元兑美元上周下跌 3.67%，收报 0.9219，最高上探 0.9641，最低下探 0.9164。上周由于澳洲联储 (RBA) 会议纪要指出澳元仍有进一步下行的空间，澳元承压走低，澳元兑美元录得自

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。

2011 年 9 月以来最大单周跌幅。因此前美联储主席伯南克表示只要经济继续改善，最早今年年内就可能削减购债规模。这令澳大利亚政府债券录得自 2001 年以来最大单周跌幅，降低该国资产的吸引力。本周澳大利亚缺乏焦点事件，重点关注众多美国经济数据和美联储官员讲话，若数据整体向好且美联储官员鹰派阵营占据上风，料将提振美元，打压汇价。阻力位 0.93，支撑位 0.9。。

表 1：国际外汇市场主要货币汇率变动

主要货币汇率变动	最新价	5 日变动%	1 个月变动%	6 个月变动%
ICE 美元指数	82.59	2.41	-1.26	3.65
欧元/美元	1.3104	-1.78	1.33	-0.86
美元/日元	98.40	3.74	-2.87	16.50
美元/加元	1.0498	3.38	1.74	5.72
美元/瑞郎	0.9360	1.38	-2.65	2.45
澳元/美元	0.9205	-4.31	-4.63	-11.48
英镑/美元	1.5379	-2.10	1.67	-5.01

数据来源：彭博

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。