

工行金融市场：外汇汇率市场上周概览

(2013年7月1日-7月5日)

◆ 外汇汇率市场上周概览 (2013年7月1日-7月5日)

- 美元指数上周上涨 1.52%，收报 84.45，最高上探 84.53，最低下探 82.97。美国 6 月非农就业人数远超预期值，导致市场对美联储提前退出 QE3 预期增强，是导致美元指数大幅上涨的直接原因。此外，虽然 7 月 4 日的欧洲央行会议和英国央行会议均维持货币政策不变，两央行行长不约而同的发表鸽派言论，严重打压欧元和英镑，间接助涨美元指数上涨。美联储在今年开始减缓 QE3 购债规模几成定局，除非美国经济发生严重恶化，很可能在 9 月份的 FOMC 会议上开始放缓购债速度。在美联储收紧流动性、新兴市场经济下行风险凸显、美元资产相对表现出色的背景下，继续看涨美元指数。阻力位 86，支撑位 83.5。
- 欧元兑美元上周下跌 1.39%，收报 1.2829，最高上探 1.3078，最低下探 1.2806。欧洲央行和英国央行会议均维持货币政策不变，但在会后的新闻发布会上，欧洲央行主席德拉吉和英国央行新任主席卡尼均发表鸽派言论，引发欧股大涨。德拉吉表示“在相当长的一段时间里”将利率维持在较低水平，甚至可

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。

能会进一步下调。受此影响，欧股大涨，STOXX 欧洲 50 指数和富时 100 指数分别大幅上涨 2.35%和 3.08%，而欧元则大幅下跌 0.75%。阻力位 1.3000，支撑位 1.2700。

- 美元兑日元上周上涨 2.08%，收报 101.20，最高上探 101.23，最低下探 99.18。周五强于预期美国消费者信心数据发布，鼓舞了对于美联储将在今年稍后开始缩减资产购买计划预期，美元兑日元至 5 周高点。本周三日央行将发布货币政策会议记录，该记录包括央行对于现在经济状况的重要观点。周四，日本央行将公布其基准利率。利率公布之后，将会发布央行货币政策报告，该报告包含对于经济前景的重要见解。阻力位 102.51，支撑位 99.88。
- 澳元兑美元上周下跌 0.78%，收报 0.9067，最高上探 0.9253，最低下探 0.9037。由于澳洲央行行长表示澳元汇价过高，或仍会进一步贬值，拖累澳元下滑。同时美国公布 6 月份非农业职位新增 19.5 万份，优于预期的 16.5 万份，5 月份数字亦向上修订至 19.5 万份，对美元带来支持。本周三，中国将公布 6 月份贸易数据，预计贸易盈余扩阔，出口收入按年升幅增加，或助澳元靠稳，周四澳洲将公布 6 月份就业数字，预计就业人数增加 5000 人，澳元或受支持。阻力位 0.92，支撑位 0.895。

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 | 84.53 | 1.82 | 3.48 | 5.23 |
| 欧元/美元 | 1.2817 | -1.73 | -3.05 | -2.34 |
| 美元/日元 | 101.15 | 1.54 | 2.42 | 15.65 |
| 美元/加元 | 129.65 | -0.22 | -0.70 | 12.96 |
| 美元/瑞郎 | 1.0584 | 0.61 | 3.75 | 7.45 |
| 澳元/美元 | 0.9659 | 2.17 | 3.05 | 4.84 |
| 英镑/美元 | 0.9047 | -1.42 | -4.08 | -13.86 |

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。