

# 工行金融市场： 外汇汇率市场上周概览

(2013 年 7 月 22 日-7 月 26 日)

## ◆ 外汇汇率市场上周概览 (2013 年 7 月 22 日-7 月 26 日)

- 美元指数上周下跌 1.17 %，收报 81.66，最高上探 82.63，最低下探 81.55。从数据上看，美国 6 月新屋销售创逾五年高位；美国 7 月 Markit 制造业 PMI 初值创四个月新高；6 月耐用品订单月率劲升 4.2%，远超预期；7 月密歇根大学消费者信心指数终值创六年最高，然而，良好的经济数据却未能提振美元走势。阻力 82，支撑 81。
- 欧元兑美元上周上涨 1.03 %，收报 1.3279，最高上探 1.3297，最低下探 1.3134。从今年二月以来，欧元兑美元就陷入区间走势 1.2650—1.3400 的区间走势。7 月 28 日当周，美元指数大幅走低并未能有效提振欧元走势，欧元兑美元全周仅上涨 1.05%最高至 1.3296。数据方面，德法欧三大 PMI 数据均走强，法国 7 月制造业 PMI 初值创 17 个月高位；德国 7 月制造业 PMI 重返扩张领域；欧元区 7 月制造业 PMI 初值创逾两年新高。同时，希腊通过了国际贷款人要求的最后一项立法，满足了获得下一批救助金的要求，而欧元区也批准了希腊新援助款发放。阻力 1.34，支撑 1.31。

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。

- 美元兑日元上周下跌 2.42%，收报 98.21，最高上探 100.73，最低下探 97.96。美元兑日元在创下 103.73 的五年高点后似乎无意再度上行。从持仓来看，投机者持有的日元净空头增至 87496 手，显示投机者对于日元继续看空的意愿有所增强。另外，市场预期日本央行短期可能不会推出新一轮宽松措施，而 6 月日本出口连续第四个月同比增长，但增速仍不及预期。过去一年里，日元兑美元贬值了 21%，这帮助提高了日本企业竞争力。但今日不及预期的出口数据表明，单靠日元贬值可能不足以维持出口增长。6 月日本连续第 12 个月录得贸易赤字，因日元走软的同时，也提高了日本的能源进口费用。另外，日本 6 月全国核心 CPI 年率升 0.4%，逆转此前 13 个月连跌之势，且创下近五年最大升幅。阻力 100，支撑 97。
- 美元兑瑞朗上周下跌 1.26%，收报 0.9282，最高上探 0.9415，最低下探 0.9261。瑞士央行行长乔丹 7 月 20 日表示，并不打算调整或废除欧元兑瑞郎 1.20 的下限，将在必要情况下继续维持当前政策不变，瑞士央行有必要在其职责范围内采取这样的行动。在瑞士央行 6 月份举行的新闻发布会上，乔丹也重申，在帮助维持适当的货币环境这一目的上，瑞士央行不会排除任何工具。国际货币基金组织在 2013 年稍早曾指责全球各大央行持有超额外汇储备，但却为瑞士央行开启绿灯，称瑞郎可能会面临另一轮升值压力。阻力位 0.94，支撑 0.92。

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。

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	81.61	-0.74	-1.88	2.57
欧元/美元	1.3280	0.74	1.82	-1.09
美元/日元	97.79	-2.13	-1.84	8.10
美元/加元	129.87	-1.41	-0.05	6.92
美元/瑞郎	1.0273	-0.68	-2.35	2.10
澳元/美元	0.9282	-1.09	-1.82	0.43
英镑/美元	0.9256	0.50	0.86	-11.40

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。