

## 主要外汇币种回顾

东方期货研究院 张一心



#### 目录



• 美元: 美元发力, 预期向好。

• 英镑: 弱势短期改变可能不大。

• 欧元: 欧洲央行维持利率水平不变,或延长QE结束时间。

• 澳元: 近期表现不俗, 就业数据不如预期。

• 日元: 近期活动较少。

• 加元: 数据不佳拖累加元。



央行	利率	现状
美联储	0.025-0.50%	维持
欧洲央行	-0.40%	维持
英国央行	0.25%	维持
日本央行	-0.10%	维持
澳大利亚央行	1.50%	维持
新西兰央行	2.25%	维持
瑞士央行	-0.75%	维持
加拿大央行	0.50%	维持

### 美国经济数据利好美元指数



	今值	预期	前值
10月纽约联储制造业指数	-6.8	1	-2
9月工业产出环比	0.1%	0.1%	-0.4%
9月CPI环比/核心CPI环比	0.3%/0.1%	0.3%/0.2%	0.2%0.3%
9月CPI同比/核心CPI同比	1.5%/2.2%	1.5%/2.3%	1.1%/2.3%
9月营建许可	1225K	1165K	1139K
9月营建许可环比	6.3%	1.1%	-0.4%
9月新屋开工	1047K	1175K	1142K
10月15日当周首次申请失 业救济人数	260K	250K	246K
10月费城联储制造业指数	9.7	5	12.8
9月成屋销售总数年化	5.47M	5.35M	5.33M
9月成屋销售总数年化环比	3.2%	0.4%	-0.9%
9月谘商会领先指标环比	0.2%	0.2%	-0.2%

#### 美元指数





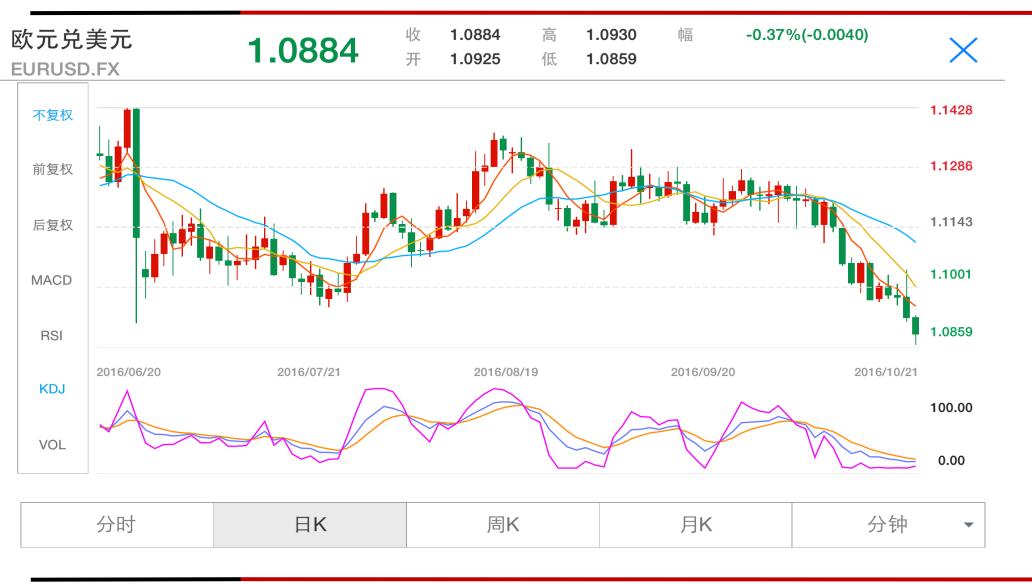
#### 欧洲央行继续保持现有利率水平



	今值	预期	前值
欧元区9月CPI环比	0.4%	0.4%	0.1%
欧元区9月CPI同比终值	0.4%	0.4%	0.4%
欧元区9月核心CPI同比 终值	0.8%	0.8%	0.8%
德国9月PPI环比	-0.2%	0.2%	-0.1%
德国9月PPI同比	-1.4%	-1.2%	-1.6%
	今值	<b>预期</b>	前值
10月20日当周欧洲央行 主要再融资利率	今值 0%	<b>预期</b> 0%	0%
主要再融资利率 10月20日当周欧洲央行	0%	0%	0%
主要再融资利率 10月20日当周欧洲央行 隔夜存款利率 10月20日当周欧洲央行	0% -0.4%	0% -0.4%	0% -0.4%

#### **EUR/USD**





欧可幅期较择多人 不可 临期较择多人。

## 英国经济数据好坏不一

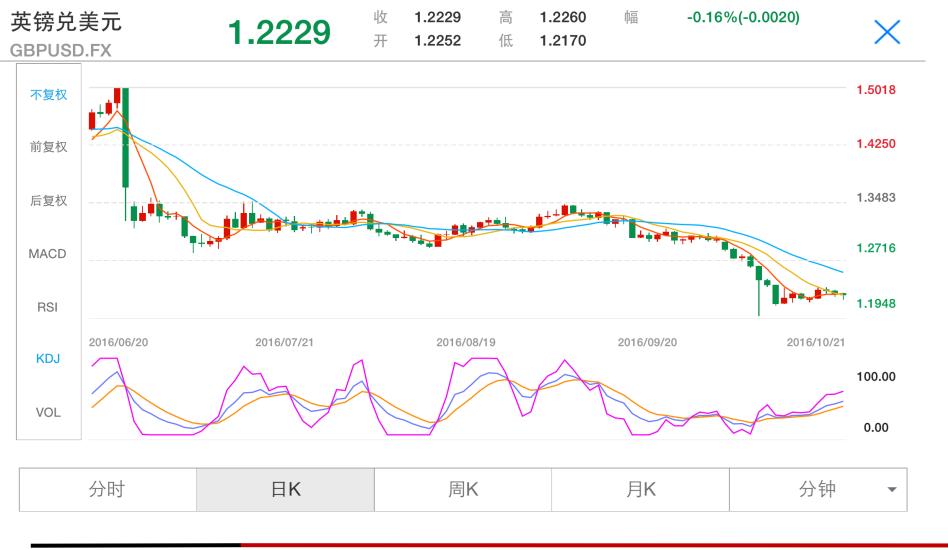


	今值	预期	前值
9月CPI环比	0.2%	0.1%	0.3%
9月CPI同比	1%	0.9%	0.6%
9月核心CPI同比	1.5%	1.4%	1.3%
9月零售物价指数环比	0.2%	0.1%	0.4%
9月零售物价指数同比	2%	2%	1.8%
9月失业率	2.3%	2.2%	2.2%
9月失业金申请人数变 动	0.7K	3.2K	2.4K
8月三个月ILO失业率	4.9%	4.9%	4.9%
9月核心零售销售环比	0%	0.2%	-0.3%
9月核心零售销售同比	4%	4.4%	5.9%
9月零售销售环比	0%	0.3%	-0.2%
9月零售销售同比	4.1%	4.7%	6.2%

英国经济数据好坏不一,虽然CPI数据不错,但是失业率上升和零售数据下降值得警惕。

#### GBP/USD





英镑本周反弹后继续 下跌,经济数据不及 预期使得英镑再次承 压,近期还有下跌的 动能,上周建议逢高 做空,下周继续建议 逢高分批做空。

#### 日本央行近期活动较少



• 近期日本央行一该前段时间的高调,我们可以观察到近期日元走势还是有所偏弱,符合央行对汇率的预期.

#### **USD/JPY**





近行大是还美高日强要下期没动日在元那圆,防跌本什,其涨数多很周美险央么但实,升,顽需元。

#### 澳联储会议纪要



- 纪要显示,澳洲经济稳步增长预期是合理的,矿业投资下降的阻力似乎在减弱,房地产风险有所下滑,但仍需密切关注房地产市场价格表现。
- 纪要还表示,保持利率不变是考虑到通胀因素和经济增长目标等情况,之后陆续出炉的新的经济数据将有助于评估此前降息效果。
- 纪要认为,澳元上涨将会令经济再平衡复杂化。大宗商品价格上涨有助于改善第三季度贸易环境,第三季度GDP增速或将接近二季度水平。
- 纪要特别提到,中国经济增速似乎已经企稳,但其债务问题仍然是令人担忧的因素。
- 澳洲联储主席洛威先前发表讲话称,澳洲联储的职责并非一直将通胀率维持在2%-3%的之间,市场应允许通胀目标暂时出现偏离,导致通胀低迷的因素仍将继续一段时间。

## 澳洲就业数据好坏不一



	今值	预期	前值
9月就业人口变动	-9.8K	15.0K	-3.9K
9月失业率	5.6%	5.7%	5.6%
9月全职就业人口 变动	-53K	-	11.5K
9月就业参与率	64.5%	64.8%	64.7%

#### AUD/USD





#### 加拿大央行保持现有利率水平



	今值	预期	前值
8月零售销售环比	-0.1%	0.3%	-0.1%
8月核心零售销售 环比	0%	0.3%	-0.1%
9月CPI环比	0.1%	0.2%	-0.2%
9月CPI同比	1.3%	1.4%	1.1%
9月核心CPI环比	0.2%	0.2%	0%
9月核心CPI同比	1.8%	1.8%	1.8%
10月19日当周加 拿大央行利率决策	0.5%	0.5%	0.5%

#### USD/CAD





数据不佳导致加 元承压下跌,下 周应该还会有所 影响,建议回调 买入做短线止赢



# 谢 谢!

研究员张一心

电话: 021-80232040

微信: 15921115786

QQ: 569121249