

2010年9月2日

上海市分行外汇交易室提供

隔夜外汇市场主要货币行情

	欧元兑美元	美元兑日元	美元兑瑞郎	英镑兑美元	澳元兑美元
开盘价	1.2685	84.1500	1.0145	1.5351	0.8920
最高价	1.2855	84.6600	1.0185	1.5491	0.9116
最低价	1.2661	83.6700	1.0060	1.5334	0.8910
收盘价	1.2806	84.4000	1.0152	1.5452	0.9108

今日汇市主要货币阻力位与支持位

	欧元兑美元	美元兑日元	美元兑瑞郎	英镑兑美元	澳元兑美元
阻力位2	1.3000	86.0000	1.0400	1.5600	0.9220
阻力位1	1.2925	85.5000	1.0350	1.5500	0.9190
支撑位1	1.2720	83.7000	1.0100	1.5320	0.9030
支撑位2	1.2625	83.5700	1.0050	1.5150	0.8980

今日中国银行人民币汇率

	现汇买入价	现钞买入价	卖出价
美元	679.7400	674.2900	682.4600
欧元	868.0200	841.2200	874.9900
日元	8.0295	7.7816	8.0940
英镑	1047.6800	1015.3400	1056.1000

风险提示：我行自2005年9月26日起，即期结售汇各货币兑人民币报价将根据国内银行间市场和国际外汇市场情况采取浮动报价方式(即一日多价)。请您于叙做交易时及时联系我行，以获取最新市场价格。最终交易牌价以我行处理业务时的成交牌价为准，已成交交易不能撤销和修改。

隔夜外汇市场回顾与分析

隔夜纽约交易时段，由于风险情绪受到良好的经济数据提振，美元兑高收益货币普跌。早间公布的中国8月制造业PMI和澳洲第二季经济增长均表现强劲，显示亚洲经济的增长势头良好。而至晚间，重量级的8月美国供应管理协会ISM制造业指数为56.3，意外超过前月。这一利好作用盖过了较差的ADP民间就业报告，也进一步带动欧美股市大幅反弹，投资人重新青睐高收益货币。欧元兑美元自欧洲时段起步，在连续升穿两道整数关口后，上探至一周半来最高的1.2831。尽管8月的欧元区Markit制造业PMI终值为2月以来最低，但周三公布的终值被小幅上调，且制造业连续扩张11个月，同样利好欧元。周四将公布的第二季度欧元区GDP修正值和欧洲央行利率决议值得关注，预计欧洲央行不会有很大动作，但可能修订其增长预期。日元隔夜走势震荡，由于早盘的ADP数据显示美国8月民间就业人口意外减少1万人，7月建筑支出跌至十年来最低水平，令盘中美元兑日元一度下探83.69。但当数据显示8月制造业增长步伐较预期更快之后，汇价跟随股市的上扬而反弹，最终回升至84上方。稍早日本民主党内重量级人物小泽一郎在份政策声明中指出，若日元升值速度过快，将执行包括汇率干预等措施。不过市场对此反应不大，投资人普遍认为在9月14日举行的执政党党首选举前，日本央行不会出手干预，欧洲货币方面，英镑兑普跌的美元反弹之乐1.54水平，基本收复前一日的失地。不过英国8月制造业PMI回落至54.3，弱于预期，为去年11月以来最低。令欧元兑英镑走强，汇价上探年初以来形成的下降压制线，有望扭转年内的整体跌势。商品货币方面，澳元兑美元跳升超过2%，至三周最高的0.9116。美元兑加元回落超过1%，盘中低见1.0485。

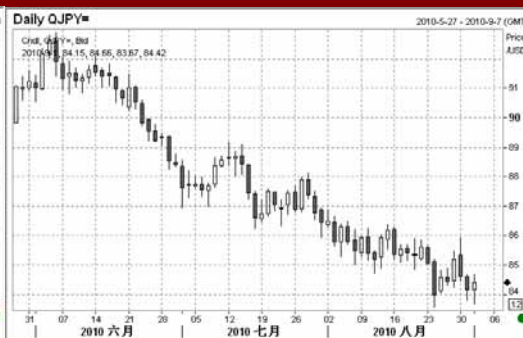
汇市分析

货币走势

欧元兑美元日K线图



美元兑日元日K线图



全球股票市场行情

股票市场	收盘	涨跌幅
道琼斯工业指数	10269.47	2.54%
标准普尔500指数	1080.29	2.95%
NASDAQ指数	2176.84	2.97%
日经225指数	8927.02	1.20%
伦敦金融时报指数	5366.41	2.70%
香港恒生指数	20623.83	0.43%

全球债券市场行情

债券市场	收盘价	收益率
美国30年期公债	104.08	3.650%
美国10年期公债	100.39	2.580%
美国2年期公债	99.74	0.505%
英国10年期公债	114.99	2.933%
德国10年期公债	100.28	2.218%
日本10年期公债	100.62	1.030%

衍生产品市场行情

期权波动率	1个月	3个月	美元2年期调期率	0.657%
美元兑日元	12.35	12.5	美元3年期调期率	0.963%
欧元兑美元	11.85	12.9	美元5年期调期率	1.594%
欧元兑日元	15.25	15.95	美元10年期调期率	2.536%
欧元CMS2年调期利率		1.244	欧元CMS30年调期利率	2.635

商品市场价格

布伦特原油(美元/桶)	76.18	黄金(美元/盎司)	1245.1
白银(美元/盎司)	19.36	白金(美元/盎司)	1530.00

银行同业拆放利率

	美元	英镑	欧元	日元	港币
隔夜	0.22625	0.54875	0.35250	0.10625	—
一周	0.25181	0.55000	0.45063	0.11438	—
一个月	0.25781	0.56870	0.57488	0.14688	0.15000
三个月	0.29563	0.72609	0.83000	0.23250	0.24893
六个月	0.49625	1.02420	1.10400	0.43500	0.37929
九个月	0.65813	1.25640	1.25344	0.58688	0.55929
十二个月	0.83988	1.46391	1.38550	0.66875	0.74857

全球主要资本市场综述

* 美国股市周三收盘大幅上扬，取得八周来最大单日涨幅，美国和中国强于预期的制造业数据提振投资者人气。道琼工业指数大涨2.54%，收报10269.47点；标准普尔500指数劲扬2.95%，报1080.29点；Nasdaq指数攀升2.97%，报2176.84点。

* 欧洲股市周三创下三个多月最大单日升幅，因全球最大的两个经济体——美国和中国的制造业数据强劲。泛欧绩优股指标300指数收高2.9%，报1055.69点，为5月27日来最大单日百分比升幅。欧洲三大股市方面，英国富时100指数收高2.7%，报5366.41点；德国DAX指数收涨2.68%，报6083.90点；法国CAC-40指数上扬3.81%，报3623.84点。

* 日股日经指数收升1.2%，脱离稍早触及的16个月低位，因中国制造业数据反弹且澳洲经济增速强于预期，令日元快速升势暂停，支撑了股市。日经指数涨至8927.02点。中国股市沪综指收跌0.6%，早间公布的中国PMI指数虽然温和反弹，但预计难持续回升，国内外经济前景不容乐观，投资者信心未见明显改善。沪综指收报2622.882点，跌0.60%。港股迎来微小的技术性反弹，此前公布的数据显示8月中国制造业活动在经历数月放缓后加速，给地区股市以提振。恒生指数收高0.43%至20623.83点，从20550点附近的支撑位反弹，近几个月该支撑位一直很牢固。

资本市场分析

道琼斯工业指数日K线图



日经指数日K线图



股票市场走势

Copyright 2006-2007 Bank of China © All rights reserved.

更多资讯请致电021-38824508或登陆www.sh.bank-of-china.com查询。

声明：本资料由中国银行上海分行外汇交易室提供，仅供参考。不构成本行的承诺或保证，本行并不保证上述资料的完整性和准确性。本行及其员工不对该资料所引起的任何后果承担责任。



整性和准确性。本行及其员工个人对该资料所引起的任何后果不承担责任。

BANK OF CHINA