外汇数据跟踪周报

投资咨询业务资格：
证监许可【2011】1289 号
研究院 FICC 组
研究员
蔡劭立
☎0755-82537411
✉caishaoli@htfc.com
从业资格号：F3063489
投资咨询号：Z0014617

联系人
高聪
☎ 021-60828524
✉ gaocong@htfc.com
从业资格号：F3063338

彭鑫
☎ 010-64405663
✉ pengxin@htfc.com
从业资格号：F3066607

汇总：

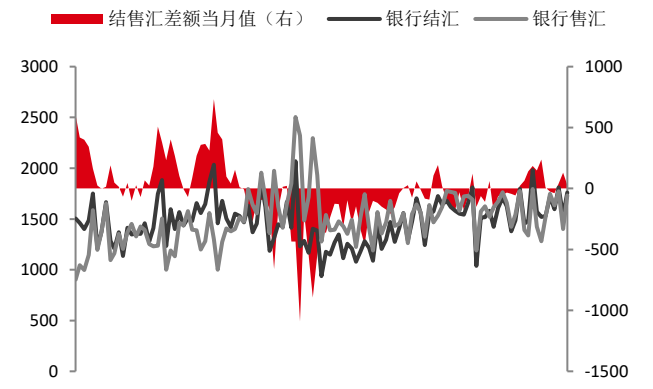
重要外汇期货合约走势	2021-01-08	2020-12-31	周变动
CME 欧元兑美元	1.2242	1.2234	0.07%
HKEX 美元兑人民币期货	6.4862	6.5355	-0.75%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0497	0.0499	-0.40%
CME 澳元兑美元	0.7769	0.7696	0.95%
CME 加元兑美元	0.7882	0.7854	0.36%
CME 英镑兑美元	1.358	1.3665	-0.62%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1837	0.192	-4.32%
CME 欧元兑美元	1.2242	1.2234	0.07%
CME 卢布兑美元	0.0134	0.0134	0.00%
CME 新西兰元兑美元	0.7241	0.7187	0.75%

美元汇率变动	2021-01-08	2020-12-31	周变动
美元指数	90.0651	89.9583	0.12%
欧元兑美元	1.2223	1.2216	0.06%
美元兑日元	103.955	103.305	0.63%
英镑兑美元	1.3564	1.3664	-0.73%
美元兑加元	1.269	1.2735	-0.35%
澳元兑美元	0.7768	0.7693	0.97%
新西兰元兑美元	0.7236	0.7183	0.74%
美元兑瑞郎	0.8854	0.8851	0.03%
美元兑港币	7.7565	7.7523	0.05%
美元兑新台币	28.017	28.09	-0.26%

人民币中间价	2021-01-08	2020-12-31	周变动
美元中间价	6.4708	6.5249	-0.83%
欧元中间价	7.9374	8.025	-1.09%
日元中间价	0.0623	0.0632	-1.43%
英镑中间价	8.7764	8.8903	-1.28%
泰铢中间价	0.2153	0.2179	-1.17%
港币中间价	0.83457	0.84164	-0.84%
林吉特中间价	0.6239	0.61833	0.90%
俄罗斯卢布中间价	11.5061	11.4011	0.92%
澳元中间价	5.027	5.0163	0.21%
加元中间价	5.1012	5.1161	-0.29%
新西兰元中间价	4.6998	4.705	-0.11%
新加坡元中间价	4.8849	4.9314	-0.94%
瑞郎中间价	7.31	7.4006	-1.22%
兰特中间价	2.3849	2.2433	6.31%
韩元中间价	168.75	166.75	1.20%
沙特里亚尔中间价	0.57977	0.57505	0.82%
迪拉姆中间价	0.56766	0.56302	0.82%
波兰兹罗提中间价	0.56895	0.57079	-0.32%
丹麦克朗中间价	0.937	0.9271	1.07%
匈牙利福林中间价	45.2733	45.4293	-0.34%
墨西哥比索中间价	3.0944	3.0486	1.50%
土耳其里拉中间价	1.13349	1.13161	0.17%
挪威克朗中间价	1.303	1.3077	-0.36%
瑞典克朗中间价	1.2656	1.2559	0.77%

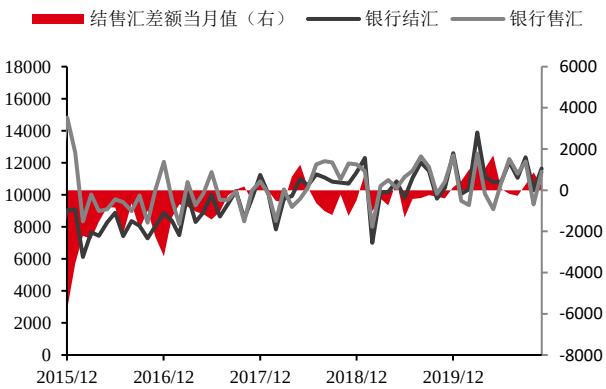
银行结售汇情况

图 1： 银行结售汇情况-美元 单位：亿美元



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 2： 银行结售汇情况-人民币 单位：亿元



数据来源：Wind 华泰期货研究院

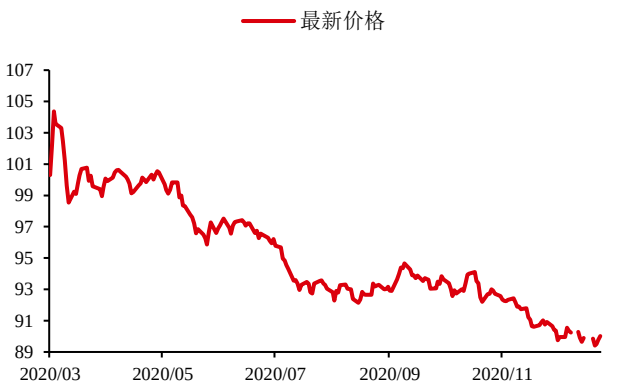
外汇期货活跃合约走势

图 3： HKEX 美元兑人民币期货活跃合约 单位：无



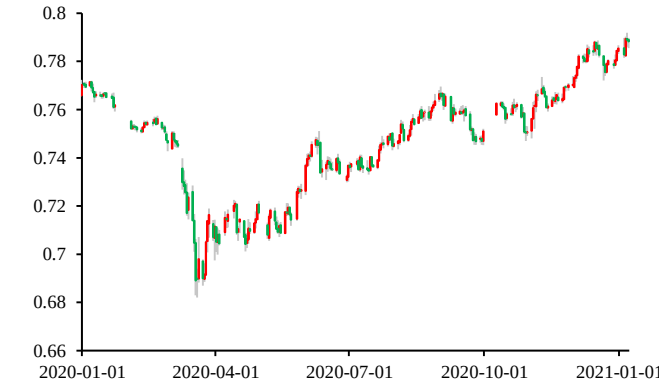
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 4： 美元指数期货 2103 合约走势 单位：无



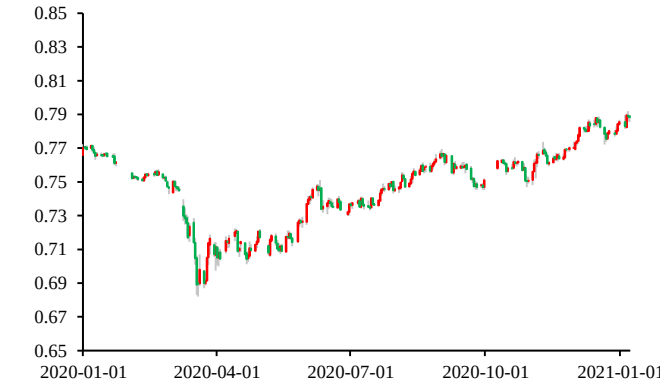
数据来源：Bloomberg 华泰期货研究院

图 5： CME 加元兑美元活跃合约 单位：无



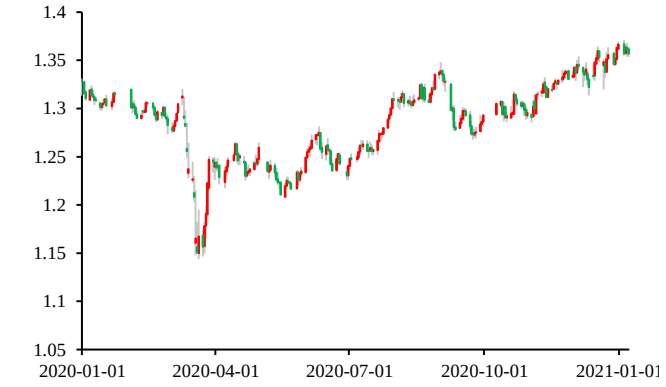
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 6： CME 日元兑美元活跃合约 单位：无



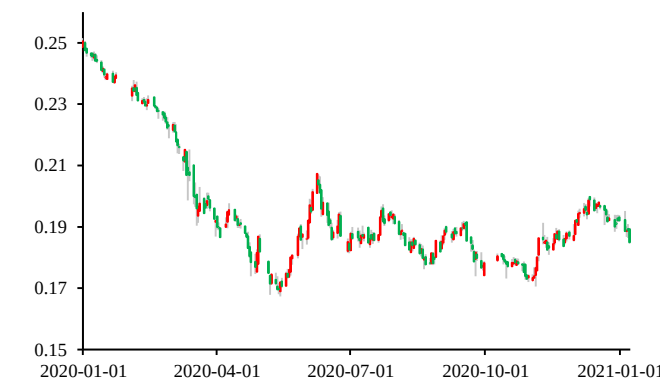
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 7： CME 英镑兑美元活跃合约 单位：无



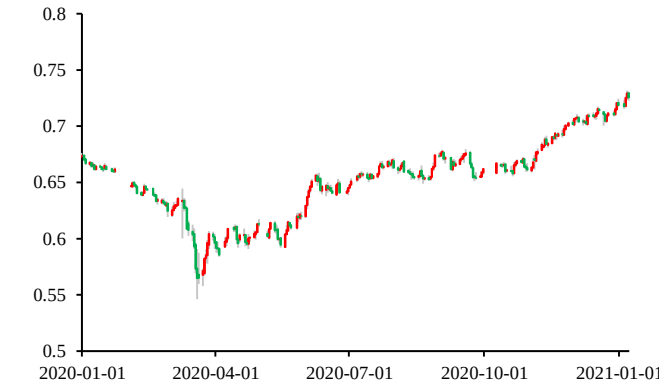
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 8： CME 巴西雷亚尔兑美元活跃合约 单位：无



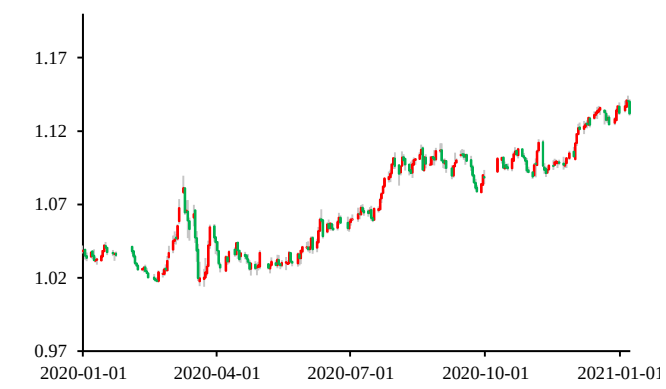
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 9： CME 新西兰元兑美元活跃合约 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 10： CME 瑞郎兑美元活跃合约 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

外汇现货价格

图 11：美元指数 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 12：欧元兑美元 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 13：美元兑日元 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 14：英镑兑美元 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 15：美元兑加元 单位：无



图 16：澳元兑美元 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

数据来源：Wind 华泰期货研究院

人民币中间价

图 17：美元中间价 单位：无



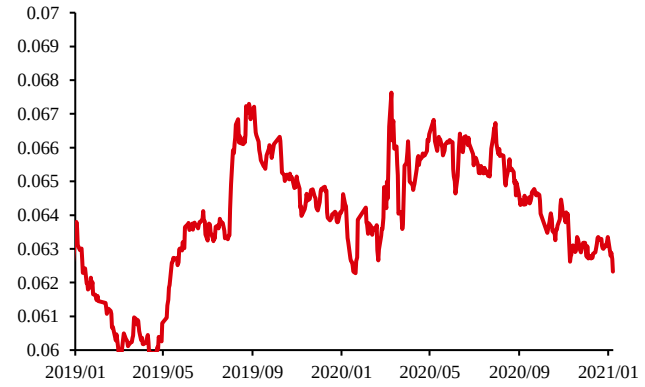
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 18：欧元中间价 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 19：日元中间价 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

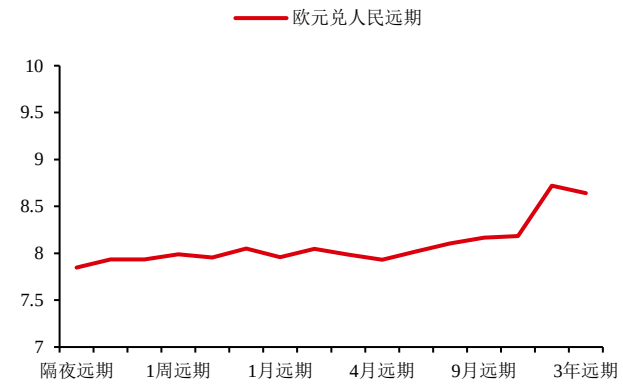
图 20：英镑中间价 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

人民币远期

图 21： 欧元兑人民币远期-不同期限 单位：无



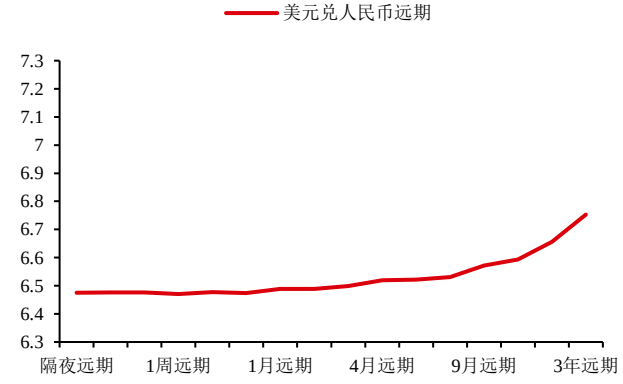
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 22： 欧元兑人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 23： 美元兑人民币远期-不同期限 单位：无



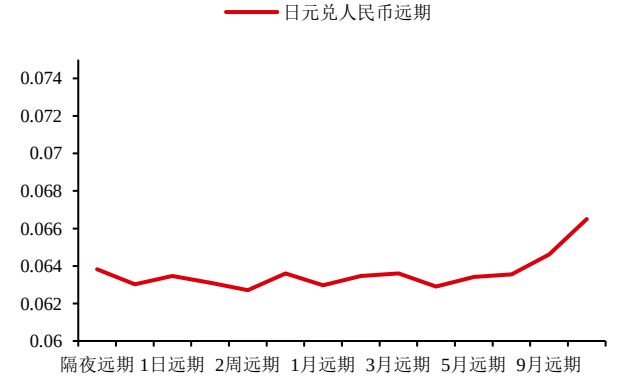
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 24： 美元兑人民币 1 月远期 单位：无



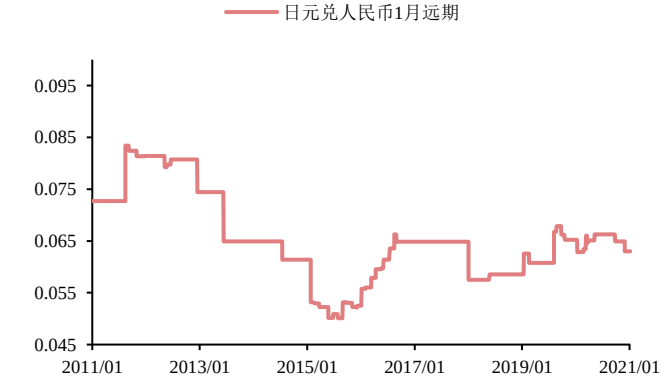
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 25： 日元兑人民币远期-不同期限 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

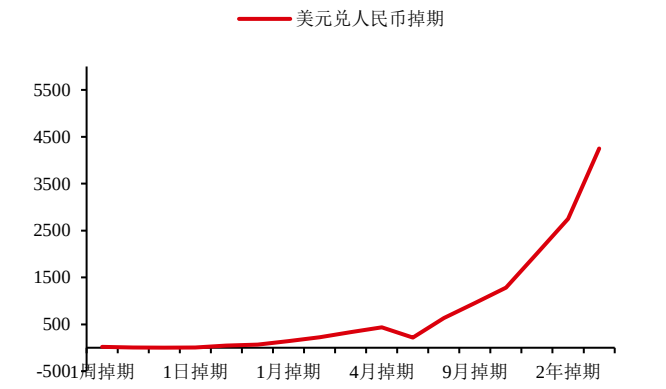
图 26： 日元兑人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

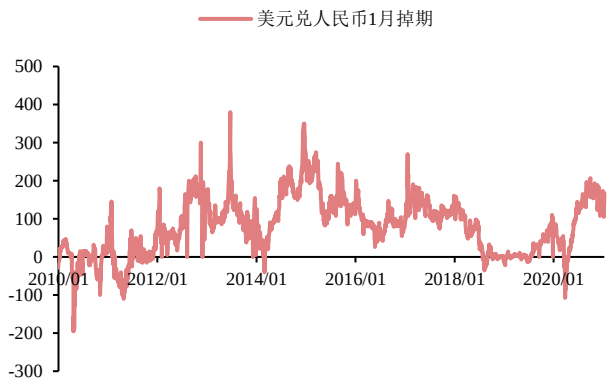
人民币掉期

图 27：美元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



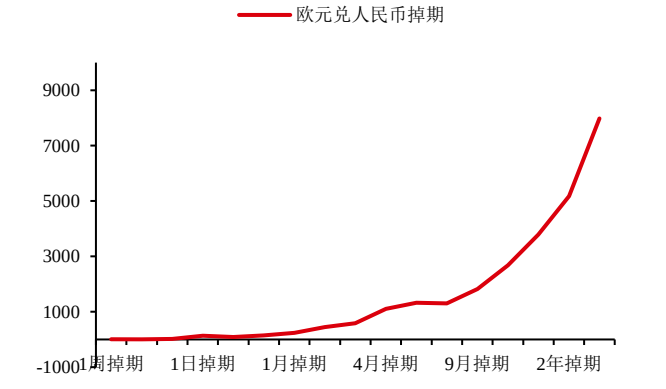
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 28：美元兑人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 29：欧元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 30：欧元兑人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 31：日元兑人民币掉期-不同期限 单位：无

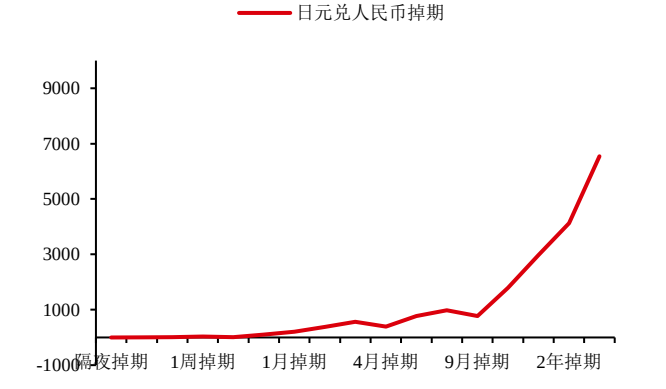
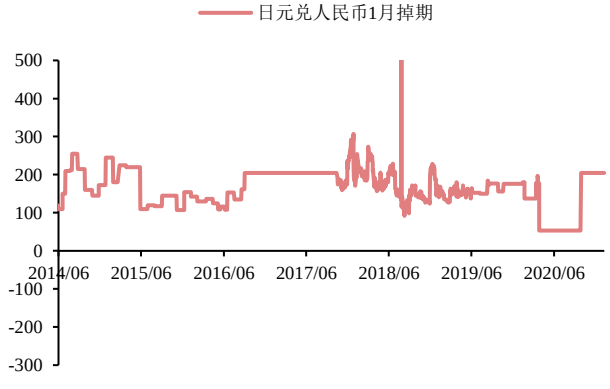


图 32：日元兑人民币 1 月掉期 单位：无

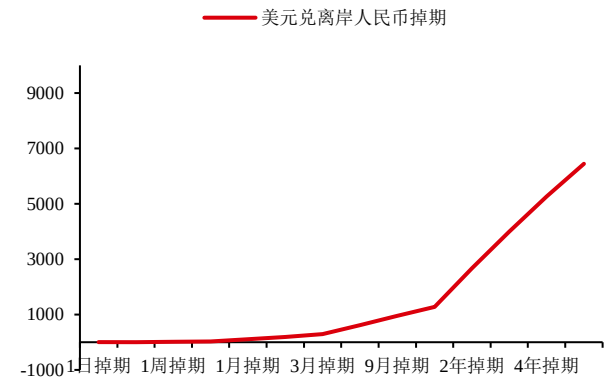


数据来源：Wind 华泰期货研究院

数据来源：Wind 华泰期货研究院

离岸人民币远期和掉期

图 33： 美元兑离岸人民币掉期-不同期限 单位：无



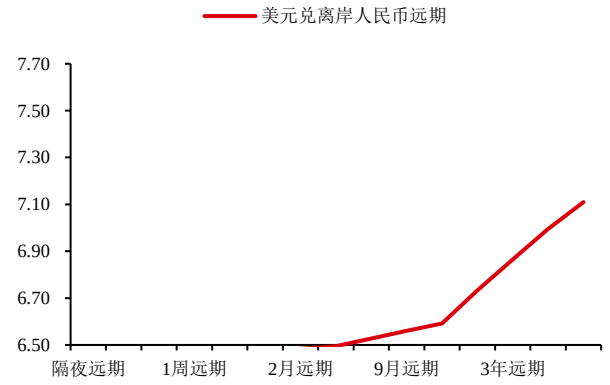
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 34： 美元兑离岸人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 35： 美元兑离岸人民币远期-不同期限 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

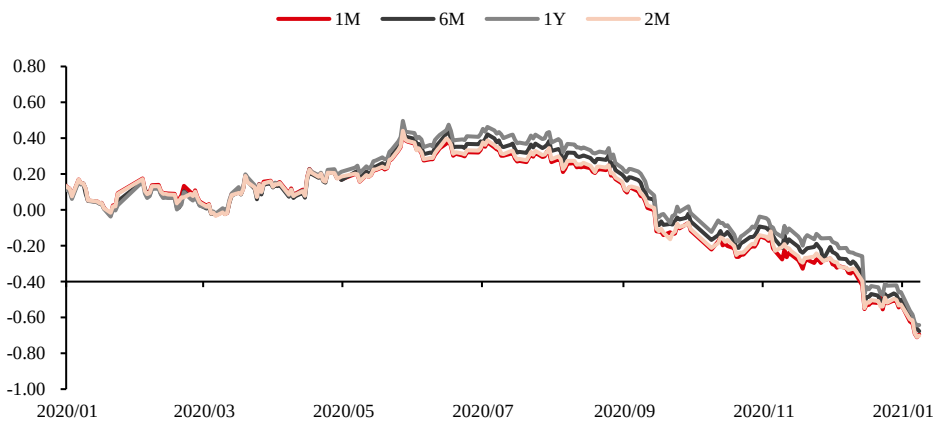
图 36： 美元兑离岸人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

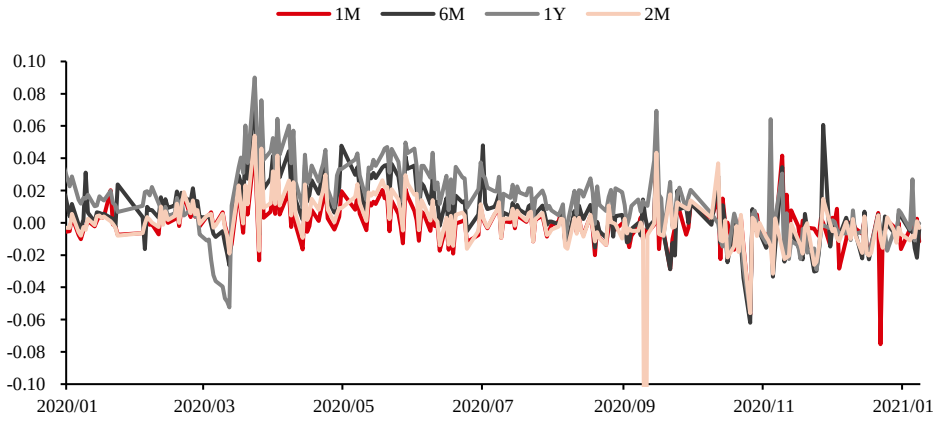
外汇价差

图 37： 美元兑人民币远期与美元兑离岸人民币远期价差 单位：无



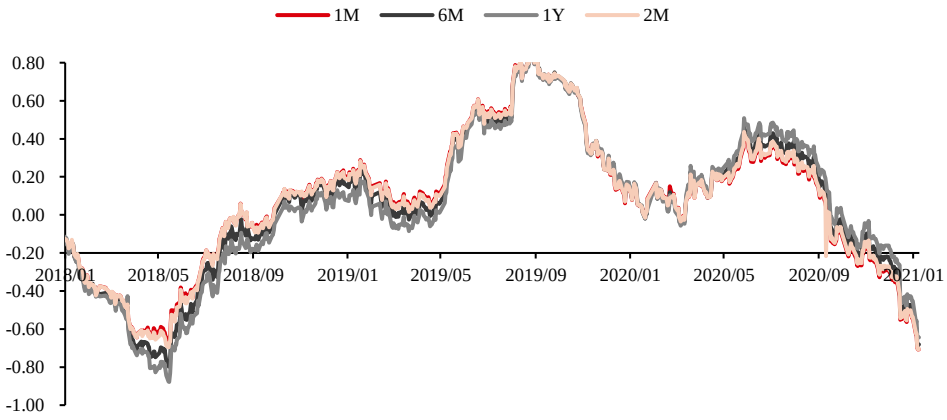
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 38： 人民币无本金交割远期和美元兑人民币远期价差 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

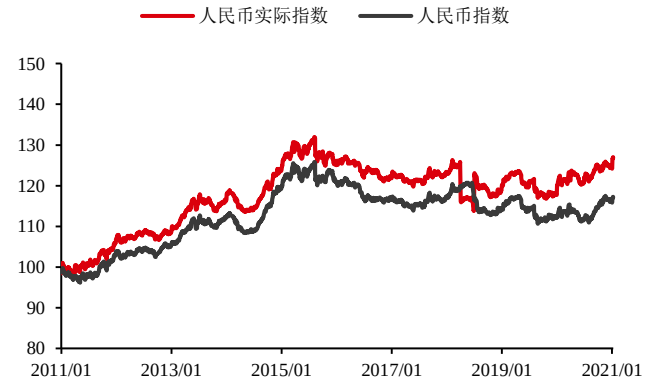
图 39： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

外汇指数

图 40： 国证人民币指数 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

数字货币

图 41： 比特币活跃合约期货价格 单位：美元/个



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 42： 比特币现货价格和成交量 单位：美元/个，个



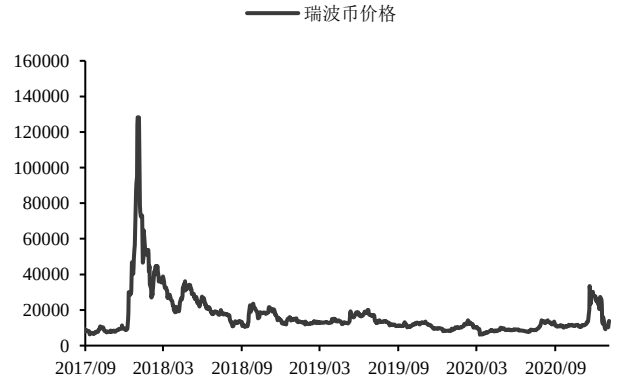
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 43： 莱特币价格 单位：美元/个



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 44： 瑞波币价格 单位：美元/个



数据来源：Wind 华泰期货研究院

免责声明

本报告基于本公司认为可靠的、已公开的信息编制，但本公司对该等信息的准确性及完整性不作任何保证。本报告所载的意见、结论及预测仅反映报告发布当日的观点和判断。在不同时期，本公司可能会发出与本报告所载意见、评估及预测不一致的研究报告。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改，投资者应当自行关注相应的更新或修改。

本公司力求报告内容客观、公正，但本报告所载的观点、结论和建议仅供参考，投资者并不能依靠本报告以取代行使独立判断。对投资者依据或者使用本报告所造成的一切后果，本公司及作者均不承担任何法律责任。

本报告版权仅为本公司所有。未经本公司书面许可，任何机构或个人不得以翻版、复制、发表、引用或再次分发他人等任何形式侵犯本公司版权。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“华泰期货研究院“，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。本公司保留追究相关责任的权力。所有本报告中使用的商标、服务标记及标记均为本公司的商标、服务标记及标记。

华泰期货有限公司版权所有并保留一切权利。

公司总部

地址：广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层

电话：400-6280-888

网址：www.htfc.com