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：

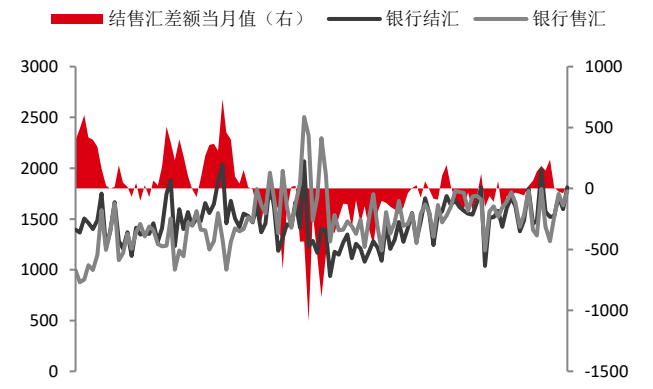
重要外汇期货合约走势	2020-11-13	2020-11-06	周变动
CME 欧元兑美元	1.1845	1.1885	-0.34%
HKEX 美元兑人民币期货	6.6288	6.631	-0.03%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0489	0.0484	1.03%
CME 澳元兑美元	0.7271	0.7263	0.11%
CME 加元兑美元	0.7613	0.7659	-0.60%
CME 英镑兑美元	1.3202	1.3151	0.39%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1832	0.1863	-1.66%
CME 欧元兑美元	1.1845	1.1885	-0.34%
CME 卢布兑美元	0.0129	0.013	-0.77%
CME 新西兰元兑美元	0.6847	0.6773	1.09%
ICE 美元指数期货	92.71	92.297	0.45%

美元汇率变动	2020-11-13	2020-11-06	周变动
美元指数	92.9706	92.5905	0.41%
欧元兑美元	1.1807	1.1827	-0.17%
美元兑日元	105.135	103.54	1.54%
英镑兑美元	1.312	1.3147	-0.21%
美元兑加元	1.3134	1.3047	0.67%
澳元兑美元	0.723	0.7284	-0.74%
新西兰元兑美元	0.6846	0.6783	0.93%
美元兑瑞郎	0.9153	0.9045	1.19%
美元兑港币	7.7542	7.7536	0.01%
美元兑新台币	28.556	28.52	0.13%

人民币中间价	2020-11-13	2020-11-06	周变动
美元中间价	6.6285	6.629	-0.01%
欧元中间价	7.8257	7.8278	-0.03%
日元中间价	0.0631	0.0639	-1.31%
英镑中间价	8.6973	8.699	-0.02%
泰铢中间价	0.2191	0.2150	1.89%
港币中间价	0.85485	0.85498	-0.02%
林吉特中间价	0.62309	0.62636	-0.52%
俄罗斯卢布中间价	11.6481	11.6267	0.18%
澳元中间价	4.7955	4.8098	-0.30%
加元中间价	5.044	5.067	-0.45%
新西兰元中间价	4.5293	4.4778	1.15%
新加坡元中间价	4.9135	4.9029	0.22%
瑞郎中间价	7.2468	7.3228	-1.04%
兰特中间价	2.3604	2.3707	-0.43%
韩元中间价	168.21	169.89	-0.99%
沙特里亚尔中间价	0.56581	0.56631	-0.09%
迪拉姆中间价	0.5541	0.55461	-0.09%
波兰兹罗提中间价	0.57355	0.57841	-0.84%
丹麦克朗中间价	0.9514	0.9517	-0.03%
匈牙利福林中间价	45.3293	45.8591	-1.16%
墨西哥比索中间价	3.1095	3.1339	-0.78%
土耳其里拉中间价	1.15941	1.27264	-8.90%
挪威克朗中间价	1.384	1.3867	-0.19%
瑞典克朗中间价	1.3036	1.3138	-0.78%

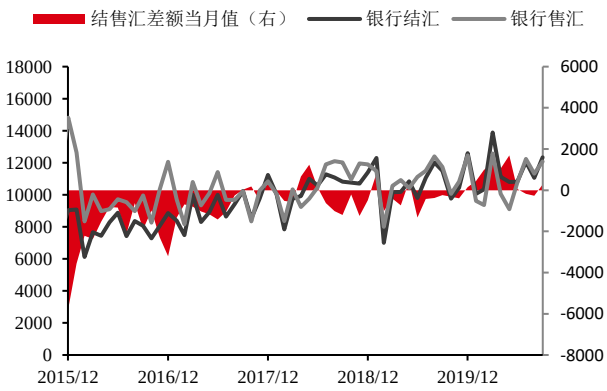
银行结售汇情况

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

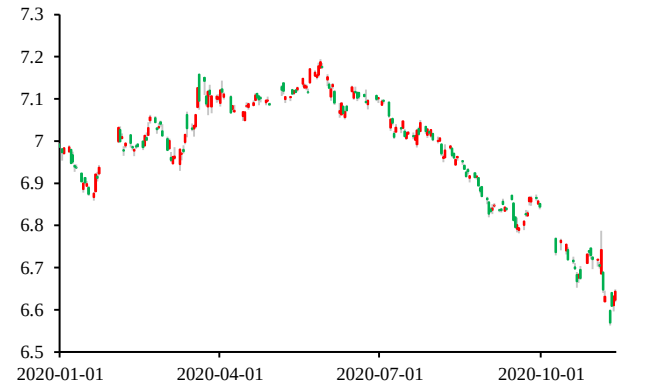
图 2：　银行结售汇情况-人民币　　单位：亿元



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



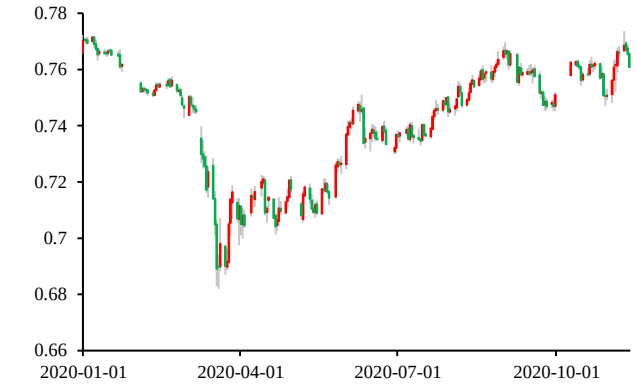
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 4：　美元指数期货 2012 合约走势　　单位：无



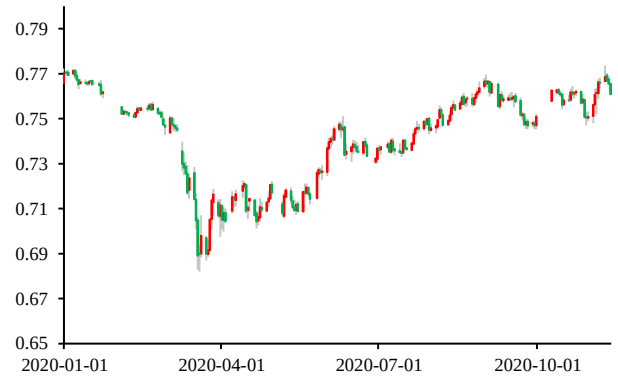
数据来源：Bloomberg 华泰期货研究院

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



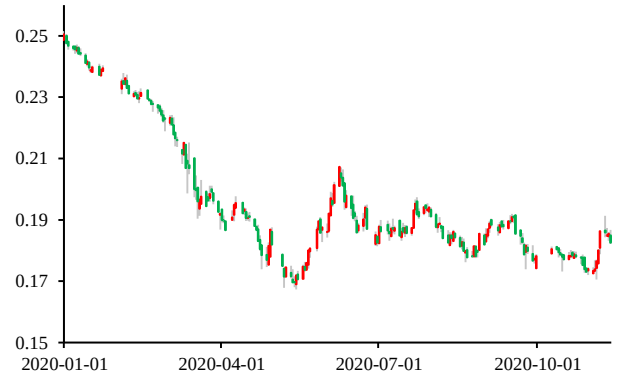
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 7： CME 英镑兑美元活跃合约 单位：无



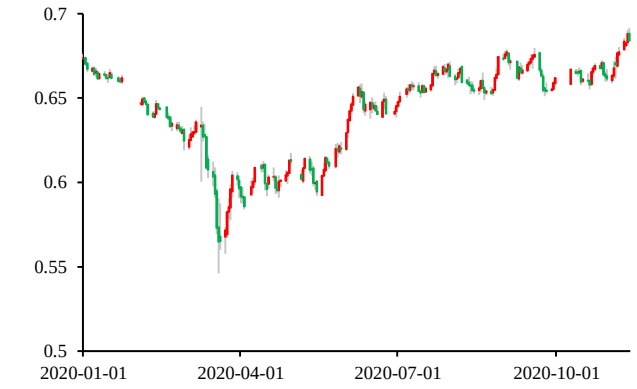
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 8： CME 巴西雷亚尔兑美元活跃合约 单位：无



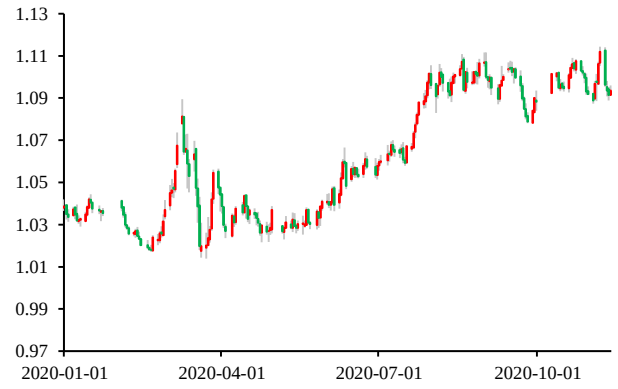
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



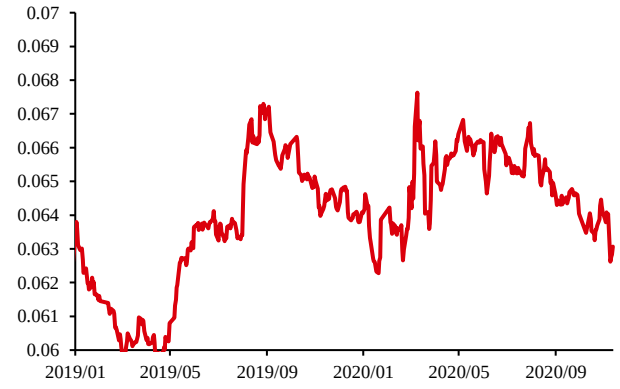
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

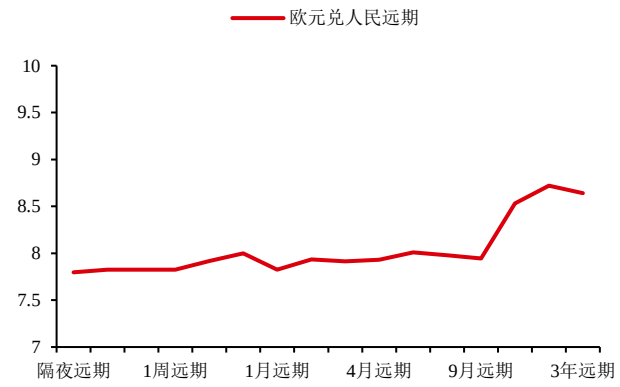
图 20：英镑中间价 单位：无



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



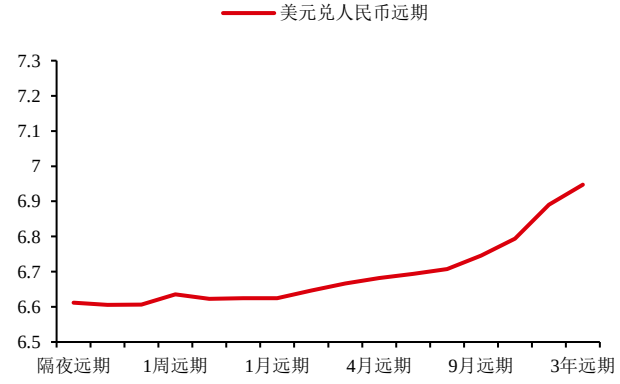
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



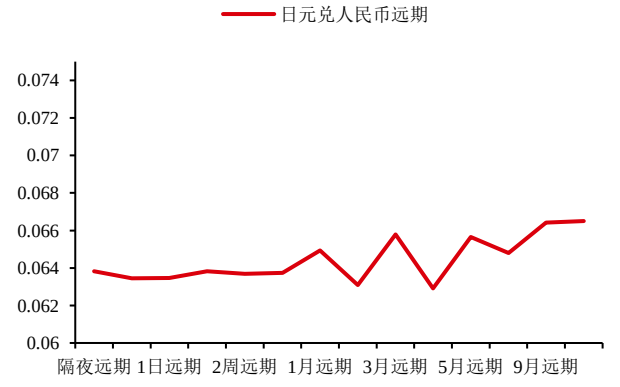
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 24： 美元兑人民币 1 月远期 单位：无



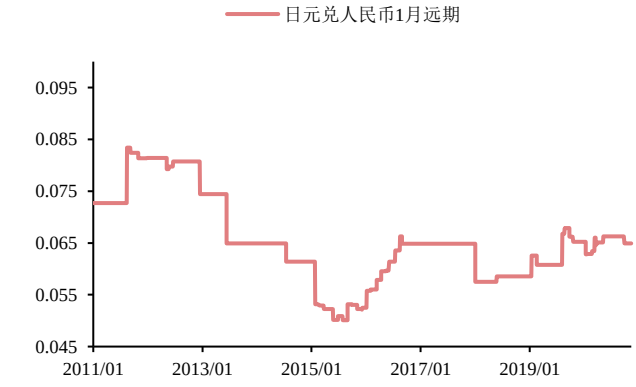
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

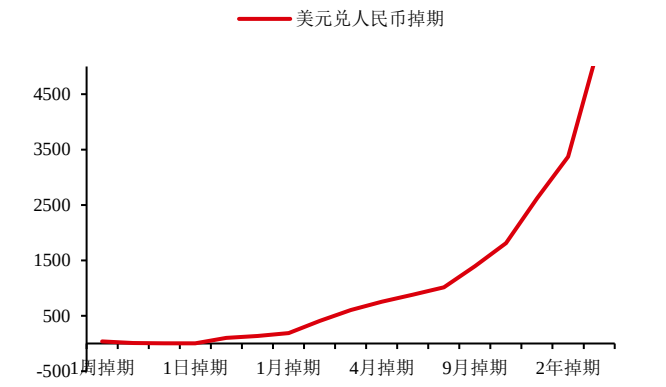
图 26： 日元兑人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

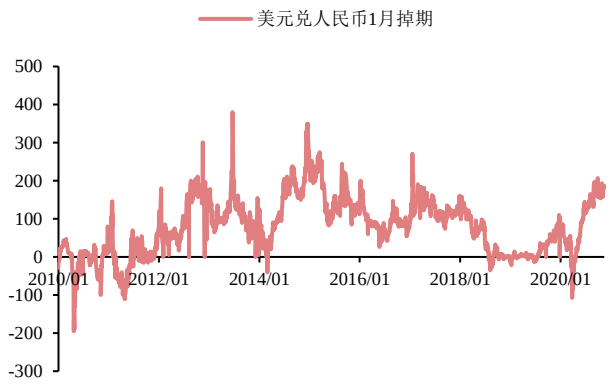
人民币掉期

图 27：美元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



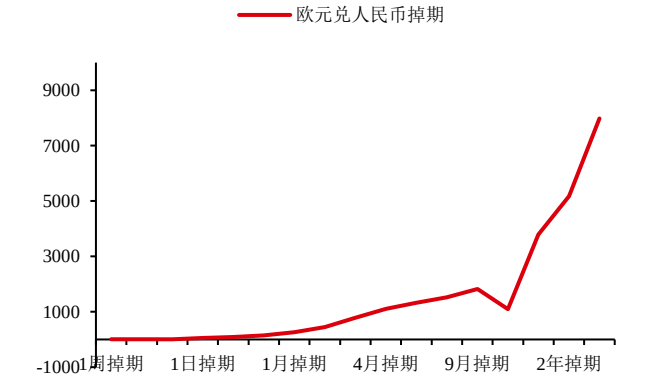
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

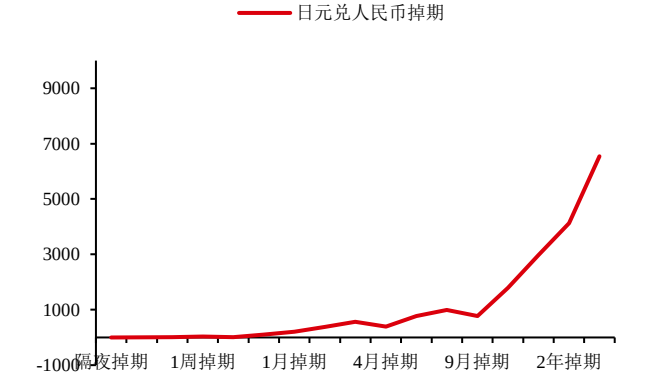


图 32：日元兑人民币 1 月掉期 单位：无

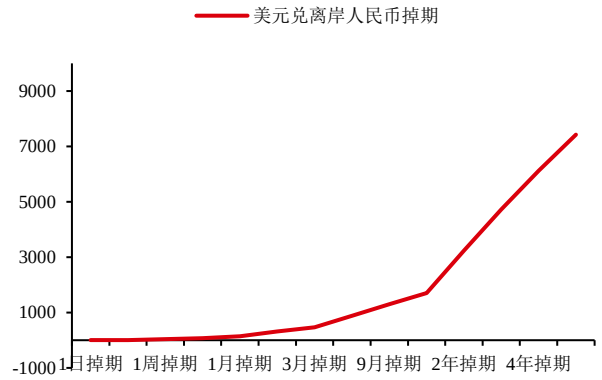


数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



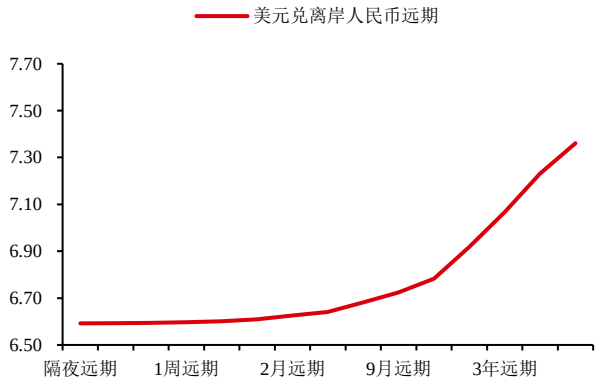
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 34： 美元兑离岸人民币 1 月远期 单位：无



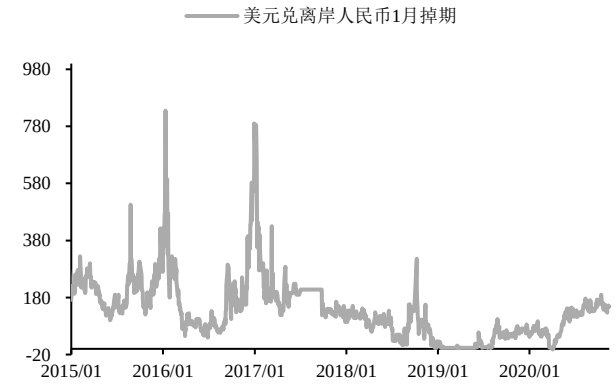
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

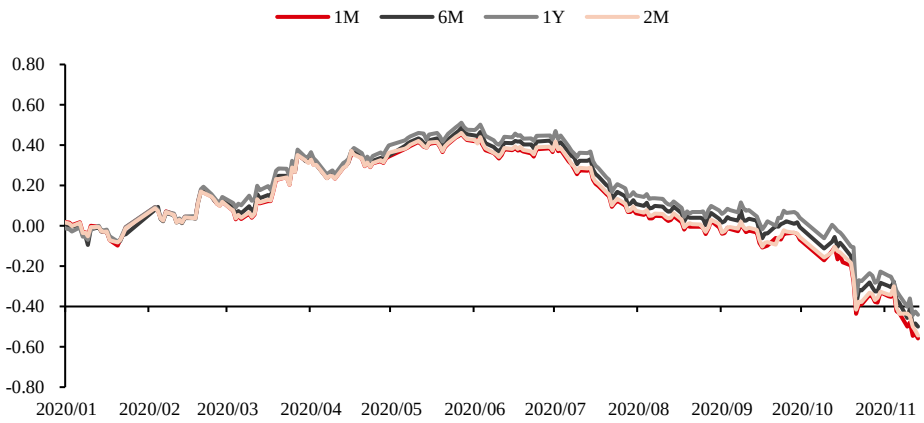
图 36： 美元兑离岸人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

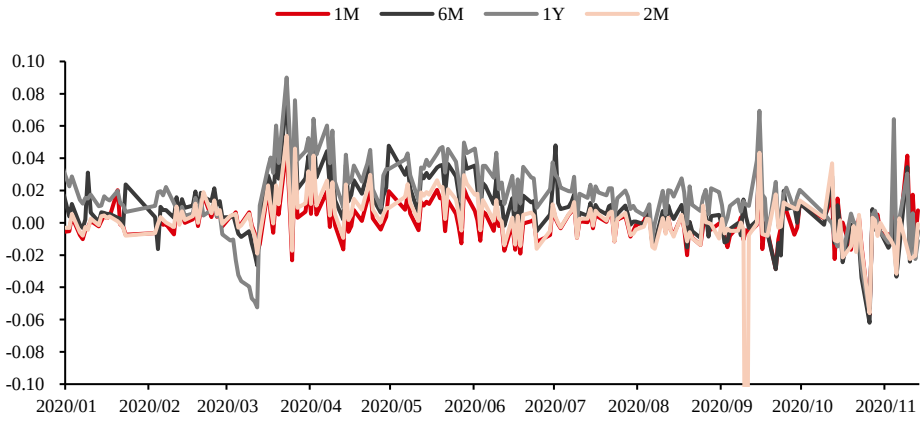
外汇价差

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



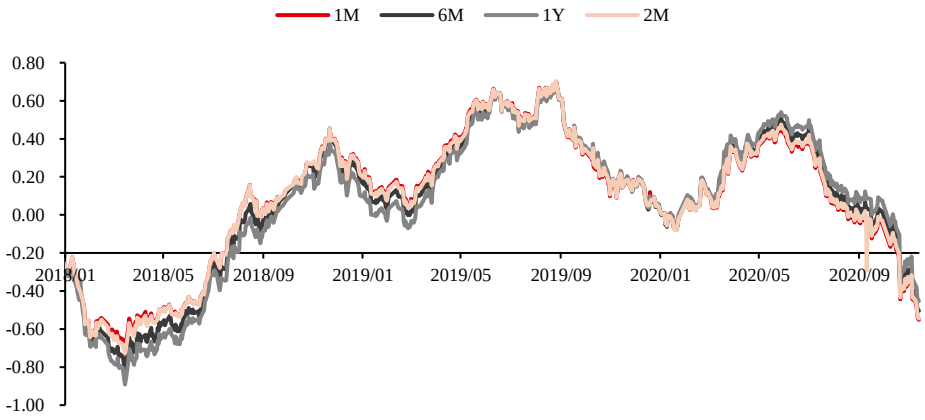
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

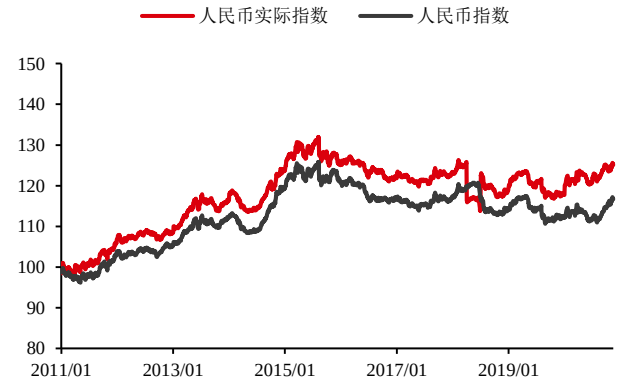
图 39： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差 单位：无



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

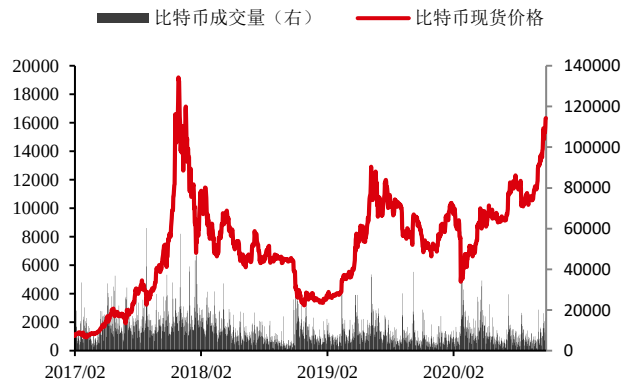
数字货币

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



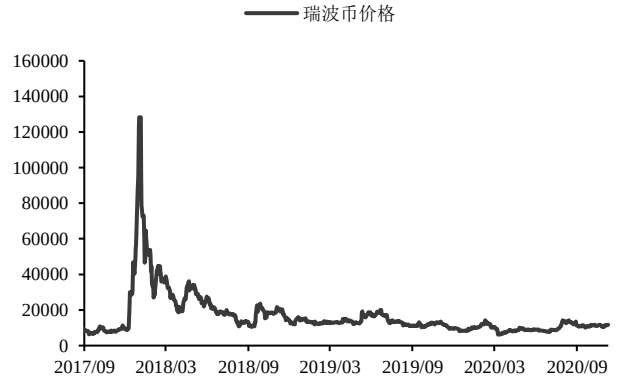
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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