# 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：

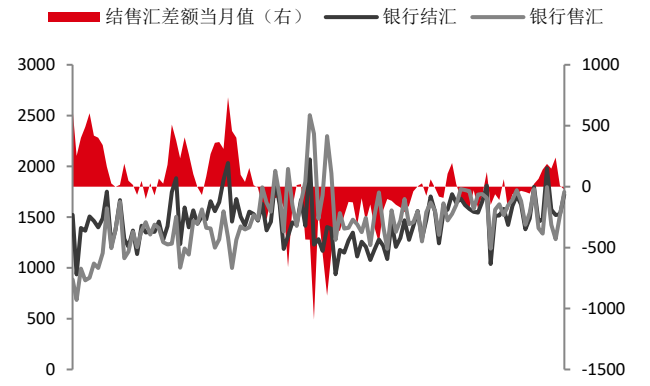
| 重要外汇期货合约走势 | 2020-09-04 | 2020-08-28 | 周变动 |
|---|---|---|---|
| CME 欧元兑美元 | 1.1841 | 1.1909 | -0.57% |
| HKEX 美元兑人民币期货 | 6.8474 | 6.8695 | -0.32% |
| CME 墨西哥比索兑美元 | 0.0464 | 0.0459 | 1.09% |
| CME 澳元兑美元 | 0.7282 | 0.7367 | -1.15% |
| CME 加元兑美元 | 0.7655 | 0.7635 | 0.26% |
| CME 英镑兑美元 | 1.328 | 1.3352 | -0.54% |
| CME 巴西雷亚尔兑美元 | 0.1884 | 0.1855 | 1.56% |
| CME 欧元兑美元 | 1.1841 | 1.1909 | -0.57% |
| CME 卢布兑美元 | 0.0133 | 0.0135 | -1.48% |
| CME 新西兰元兑美元 | 0.6719 | 0.6743 | -0.36% |
| ICE 美元指数期货 | 92.808 | 92.287 | 0.56% |

| 美元汇率变动 | 2020-09-04 | 2020-08-28 | 周变动 |
|---|---|---|---|
| 美元指数 | 92.8208 | 92.2833 | 0.58% |
| 欧元兑美元 | 1.1839 | 1.1906 | -0.56% |
| 美元兑日元 | 106.235 | 105.365 | 0.83% |
| 英镑兑美元 | 1.3278 | 1.3353 | -0.56% |
| 美元兑加元 | 1.3059 | 1.3096 | -0.28% |
| 澳元兑美元 | 0.7282 | 0.7366 | -1.14% |
| 新西兰元兑美元 | 0.6732 | 0.6736 | -0.06% |
| 美元兑瑞郎 | 0.9134 | 0.9041 | 1.03% |
| 美元兑港币 | 7.7506 | 7.7506 | 0.00% |
| 美元兑新台币 | 29.339 | 29.388 | -0.17% |

| 人民币中间价 | 2020-09-04 | 2020-08-28 | 周变动 |
|---|---|---|---|
| 美元中间价 | 6.8359 | 6.8891 | -0.77% |
| 欧元中间价 | 8.0974 | 8.1391 | -0.51% |
| 日元中间价 | 0.0644 | 0.0646 | -0.22% |
| 英镑中间价 | 9.0694 | 9.0888 | -0.21% |
| 泰铢中间价 | 0.2176 | 0.2203 | -1.22% |
| 港币中间价 | 0.88203 | 0.88891 | -0.77% |
| 林吉特中间价 | 0.60648 | 0.60577 | 0.12% |
| 俄罗斯卢布中间价 | 11.003 | 10.8808 | 1.12% |
| 澳元中间价 | 4.9632 | 4.9999 | -0.73% |
| 加元中间价 | 5.2041 | 5.247 | -0.82% |
| 新西兰元中间价 | 4.5755 | 4.5735 | 0.04% |
| 新加坡元中间价 | 5.0067 | 5.0411 | -0.68% |
| 瑞郎中间价 | 7.5145 | 7.5739 | -0.78% |
| 兰特中间价 | 2.4515 | 2.476 | -0.99% |
| 韩元中间价 | 173.94 | 172.19 | 1.02% |
| 沙特里亚尔中间价 | 0.54868 | 0.54457 | 0.75% |
| 迪拉姆中间价 | 0.53731 | 0.53332 | 0.75% |
| 波兰兹罗提中间价 | 0.54793 | 0.54184 | 1.12% |
| 丹麦克朗中间价 | 0.9189 | 0.9145 | 0.48% |
| 匈牙利福林中间价 | 44.313 | 43.7426 | 1.30% |
| 墨西哥比索中间价 | 3.1745 | 3.2149 | -1.26% |
| 土耳其里拉中间价 | 1.08769 | 1.06846 | 1.80% |
| 挪威克朗中间价 | 1.3061 | 1.2938 | 0.95% |
| 瑞典克朗中间价 | 1.2784 | 1.2669 | 0.91% |

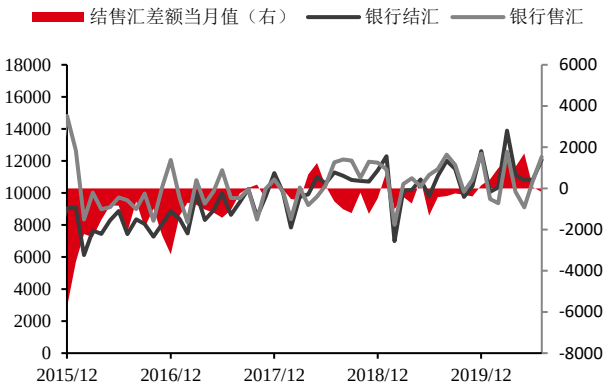
## 银行结售汇情况

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

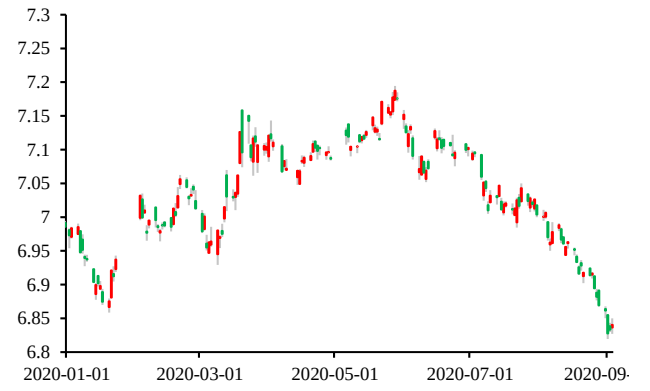
图 2： 银行结售汇情况-人民币 单位：亿元




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



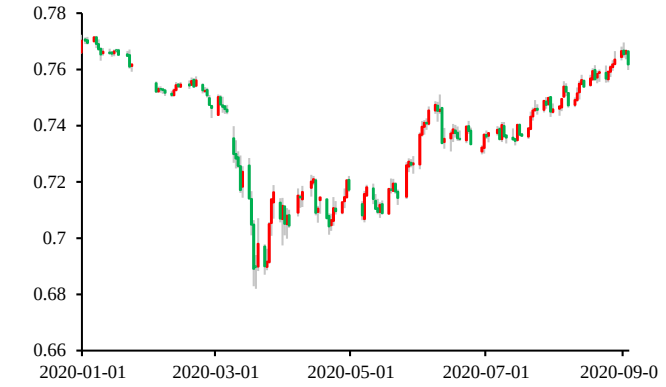

数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 4： 美元指数期货 2009 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



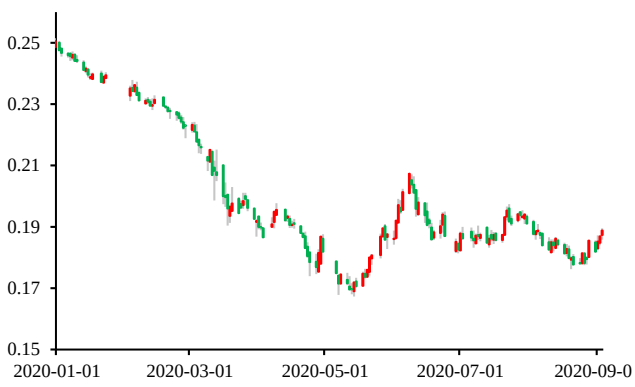

数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 7： CME 英镑兑美元活跃合约 单位：无



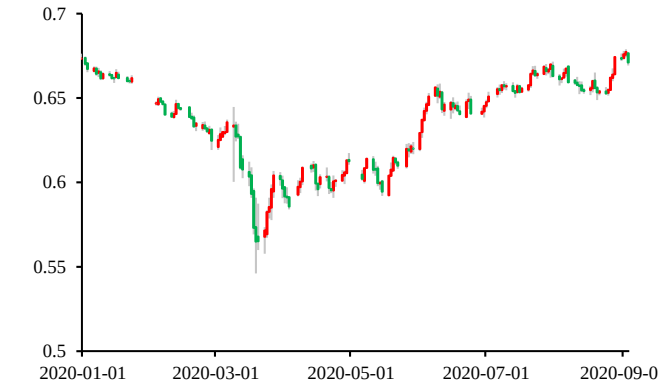

数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 8： CME 巴西雷亚尔兑美元活跃合约 单位：无



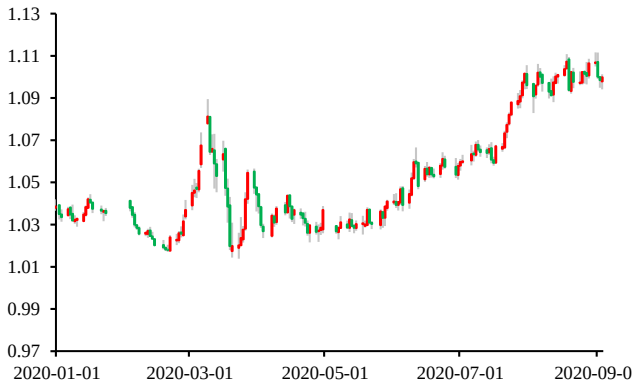

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



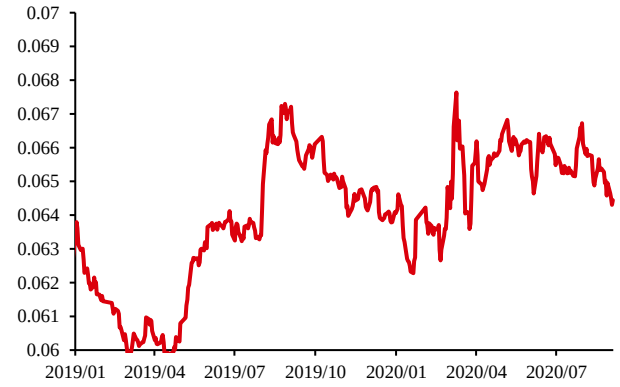

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

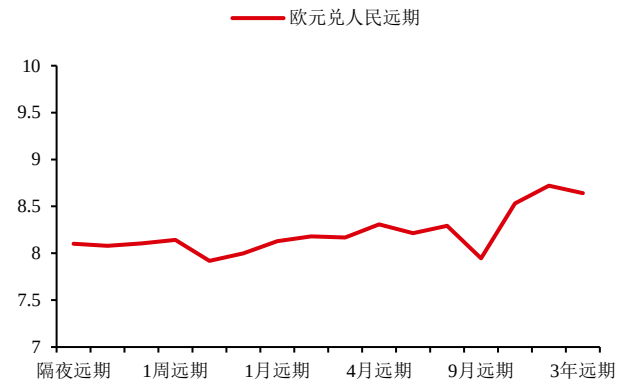
图 20： 英镑中间价 单位：无




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



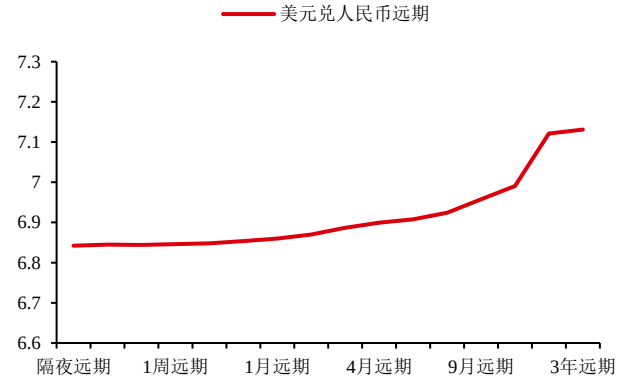

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



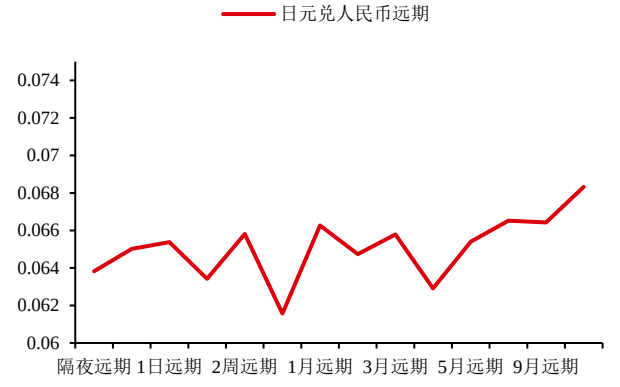

数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 24： 美元兑人民币 1 月远期 单位：无



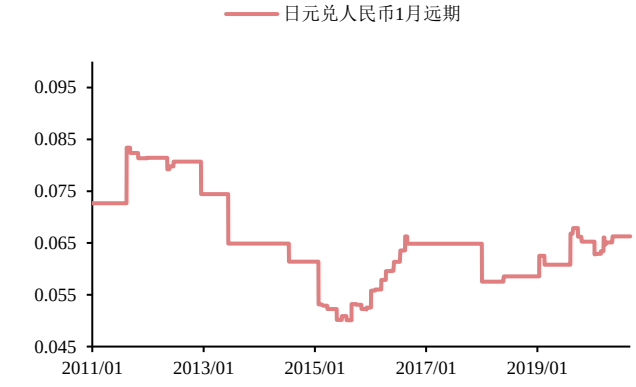

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

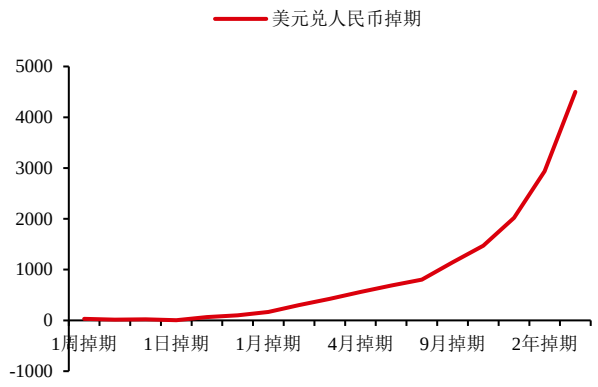
图 26： 日元兑人民币 1 月远期 单位：无




数据来源：Wind 华泰期货研究院

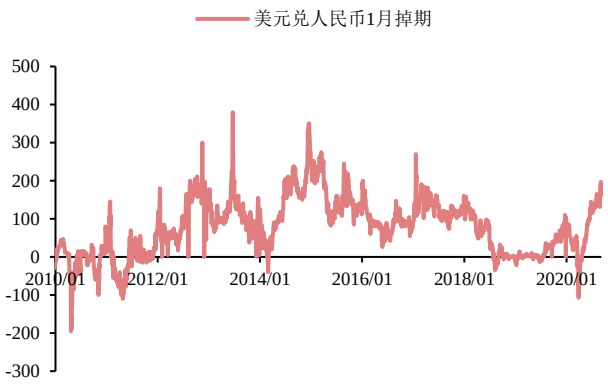
## 人民币掉期

图 27：美元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



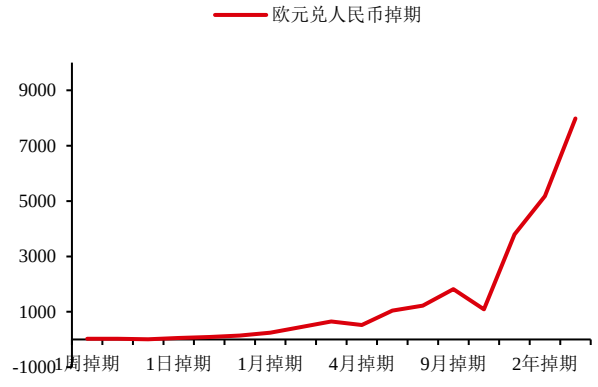

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

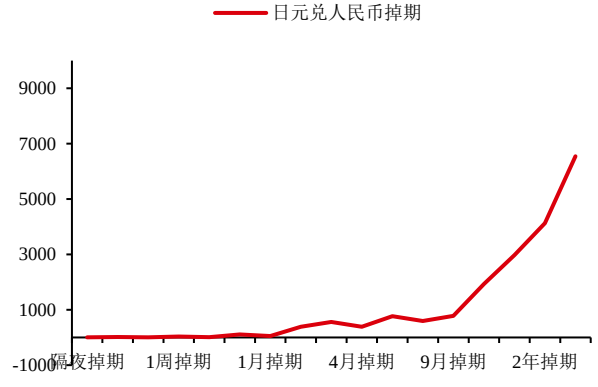



图 32：日元兑人民币 1 月掉期 单位：无

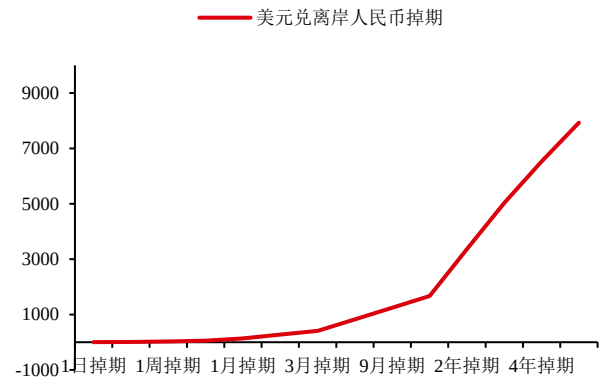


数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



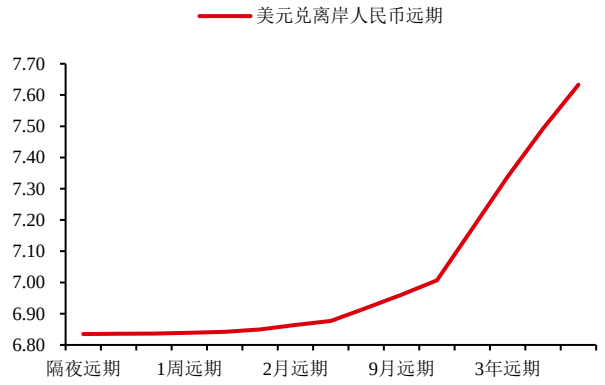

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

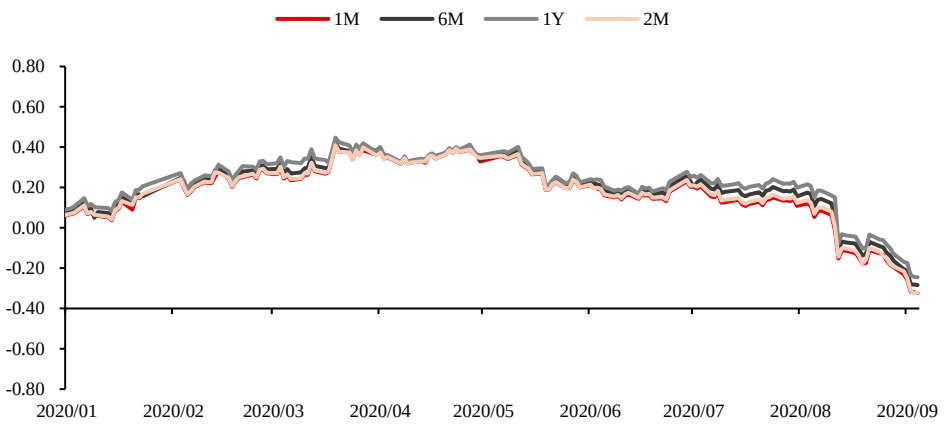
图 36： 美元兑离岸人民币 1 月掉期 单位：无




数据来源：Wind 华泰期货研究院

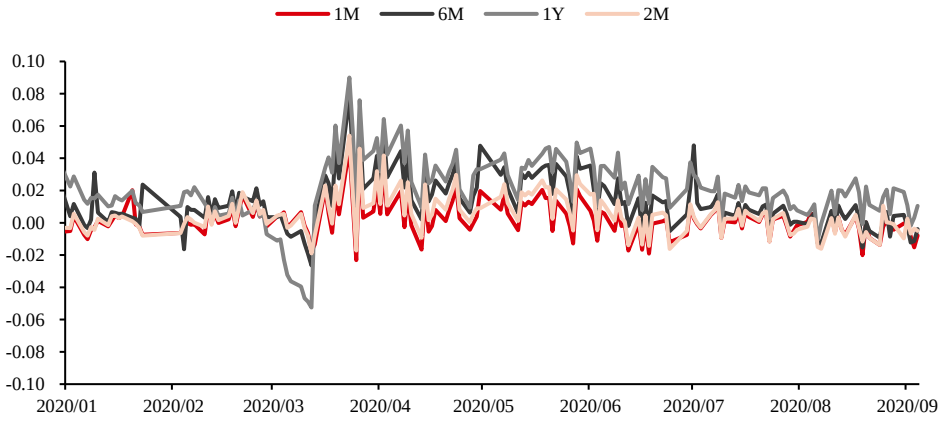
## 外汇价差

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



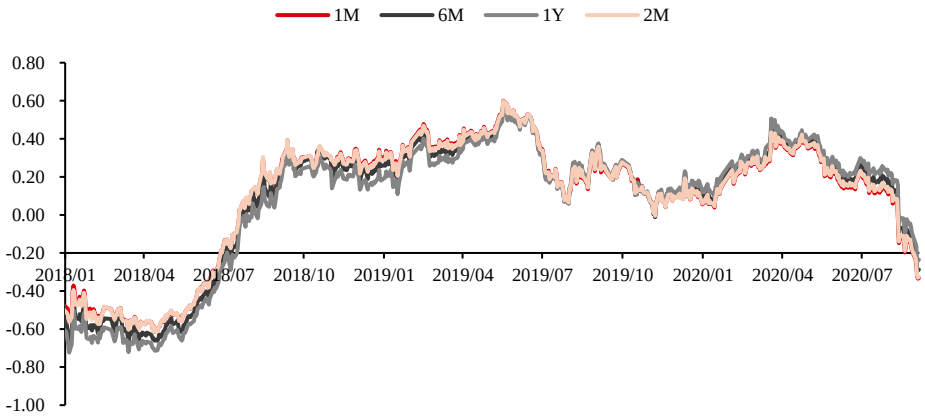

数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

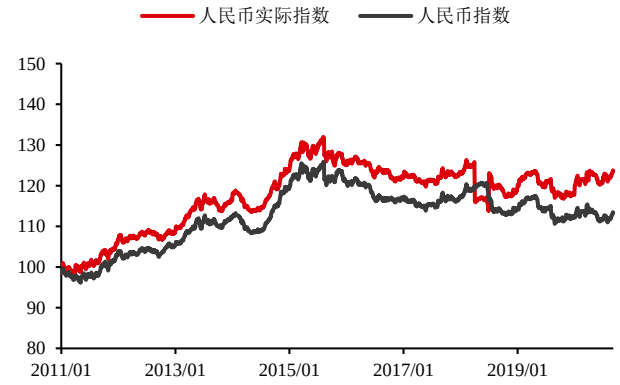
图 39： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差 单位：无




数据来源：Wind 华泰期货研究院

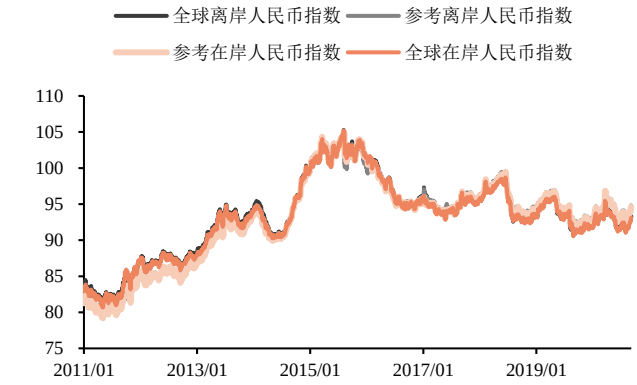
## 外汇指数

图 40： 国证人民币指数 单位：无




数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 41： RXY 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 42： 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 43： 比特币现货价格和成交量 单位：美元/个，个



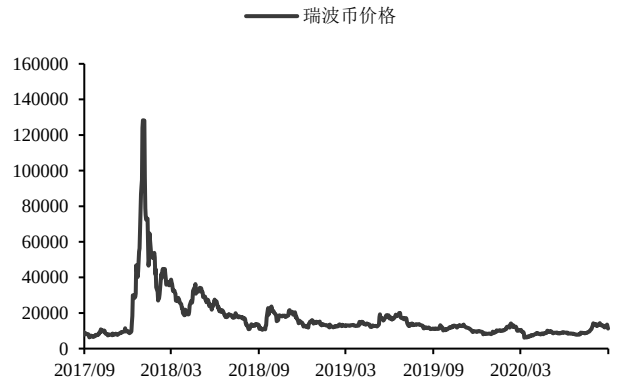

数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 44： 莱特币价格 单位：美元/个




数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 45： 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