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：

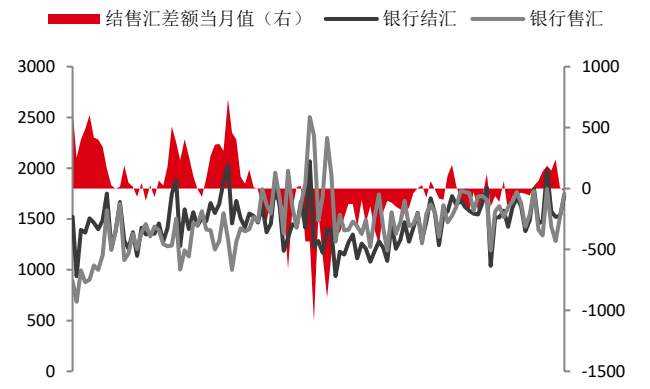
重要外汇期货合约走势	2020-08-28	2020-08-21	周变动
CME 欧元兑美元	1.1909	1.1802	0.91%
HKEX 美元兑人民币期货	6.8695	6.9175	-0.69%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0459	0.0454	1.10%
CME 澳元兑美元	0.7367	0.7161	2.88%
CME 加元兑美元	0.7635	0.759	0.59%
CME 英镑兑美元	1.3352	1.3091	1.99%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1855	0.1777	4.39%
CME 欧元兑美元	1.1909	1.1802	0.91%
CME 卢布兑美元	0.0135	0.0135	0.00%
CME 新西兰元兑美元	0.6743	0.654	3.10%
ICE 美元指数期货	92.287	93.205	-0.98%

美元汇率变动	2020-08-28	2020-08-21	周变动
美元指数	92.2833	93.2062	-0.99%
欧元兑美元	1.1906	1.1797	0.92%
美元兑日元	105.365	105.79	-0.40%
英镑兑美元	1.3353	1.3086	2.04%
美元兑加元	1.3096	1.3187	-0.69%
澳元兑美元	0.7366	0.716	2.88%
新西兰元兑美元	0.6736	0.6538	3.03%
美元兑瑞郎	0.9041	0.9117	-0.83%
美元兑港币	7.7506	7.7504	0.00%
美元兑新台币	29.388	29.4015	-0.05%

人民币中间价	2020-08-28	2020-08-21	周变动
美元中间价	6.8891	6.9107	-0.31%
欧元中间价	8.1391	8.1987	-0.73%
日元中间价	0.0646	0.0654	-1.18%
英镑中间价	9.0888	9.132	-0.47%
泰铢中间价	0.2203	0.2200	0.12%
港币中间价	0.88891	0.89167	-0.31%
林吉特中间价	0.60577	0.60432	0.24%
俄罗斯卢布中间价	10.8808	10.6845	1.84%
澳元中间价	4.9999	4.974	0.52%
加元中间价	5.247	5.2428	0.08%
新西兰元中间价	4.5735	4.5143	1.31%
新加坡元中间价	5.0411	5.055	-0.27%
瑞郎中间价	7.5739	7.6144	-0.53%
兰特中间价	2.476	2.4973	-0.85%
韩元中间价	172.19	171.52	0.39%
沙特里亚尔中间价	0.54457	0.54299	0.29%
迪拉姆中间价	0.53332	0.53174	0.30%
波兰兹罗提中间价	0.54184	0.53449	1.38%
丹麦克朗中间价	0.9145	0.9081	0.70%
匈牙利福林中间价	43.7426	42.5229	2.87%
墨西哥比索中间价	3.2149	3.1981	0.53%
土耳其里拉中间价	1.06846	1.05691	1.09%
挪威克朗中间价	1.2938	1.2894	0.34%
瑞典克朗中间价	1.2669	1.2598	0.56%

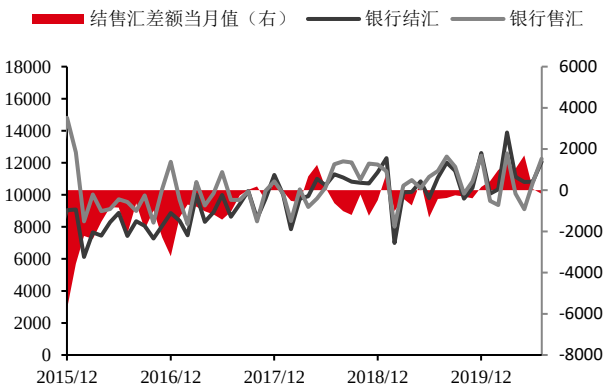
银行结售汇情况

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

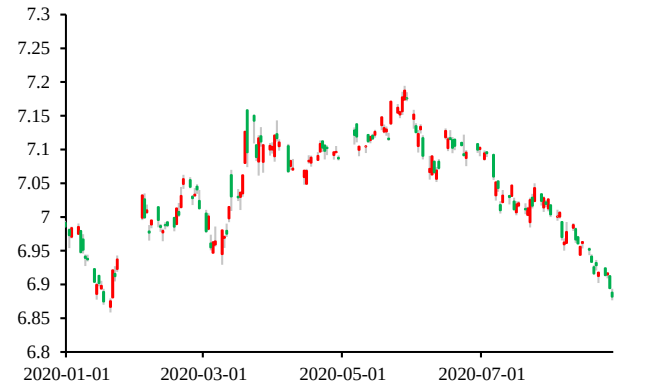
图 2： 银行结售汇情况-人民币 单位：亿元



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



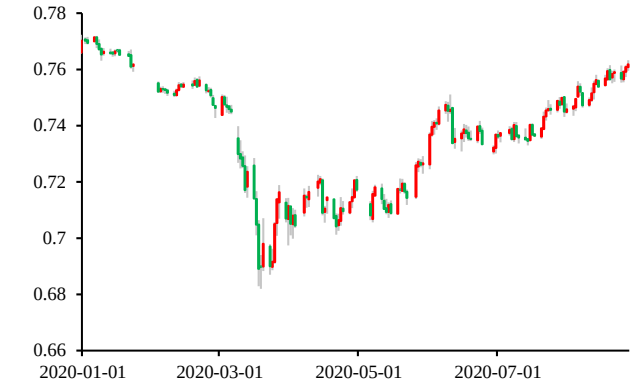
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 4： 美元指数期货 2009 合约走势 单位：无



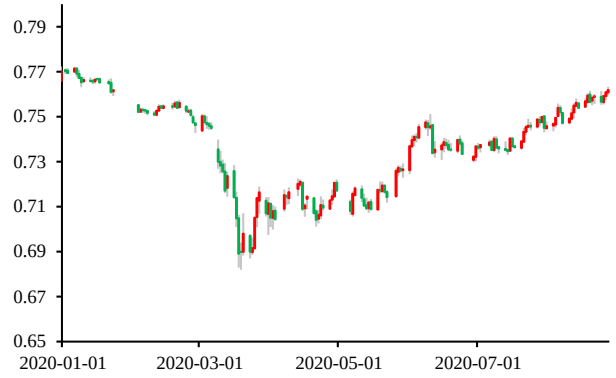
数据来源：Bloomberg 华泰期货研究院

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



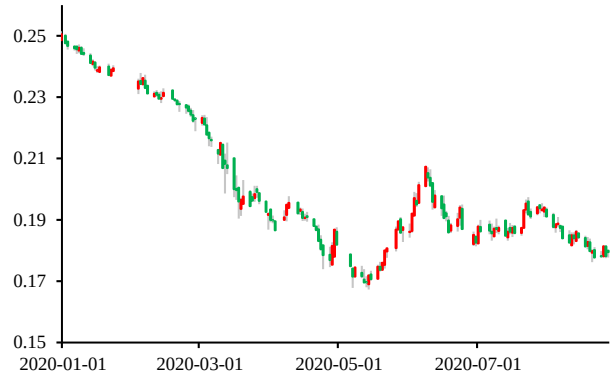
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



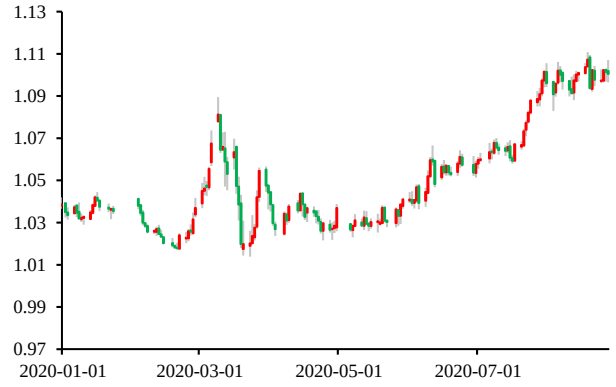
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



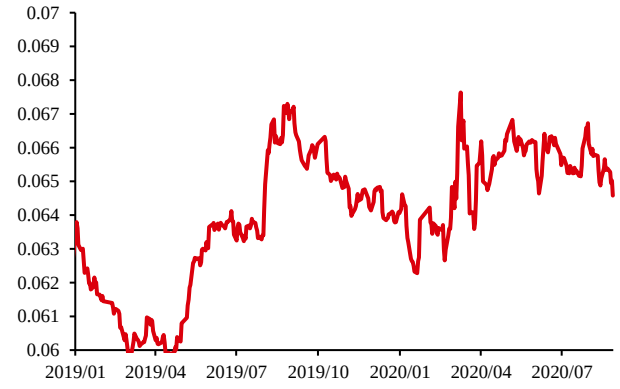
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

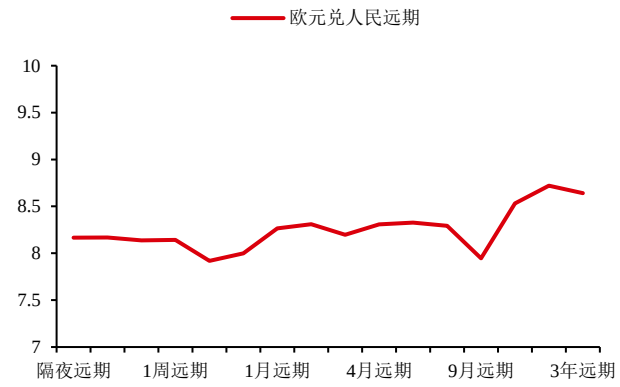
图 20： 英镑中间价 单位：无



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



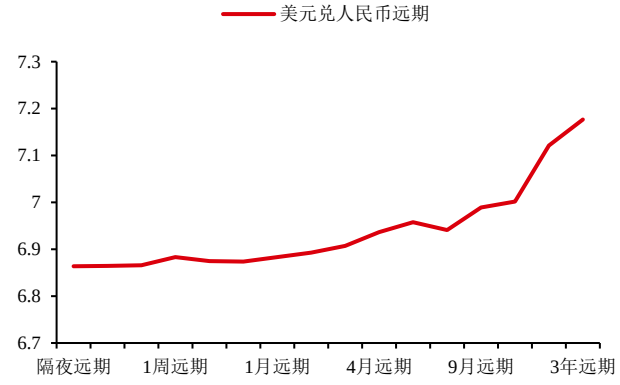
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



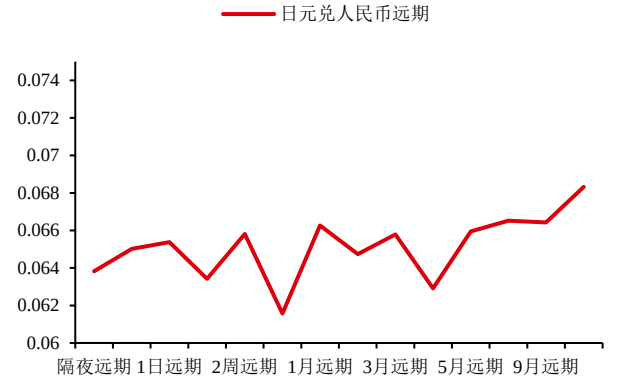
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 24： 美元兑人民币 1 月远期 单位：无



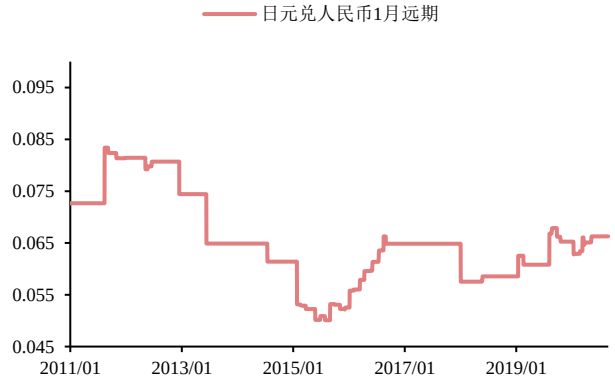
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

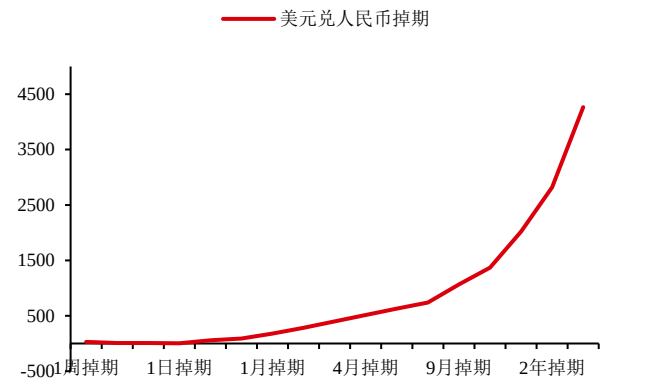
图 26： 日元兑人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

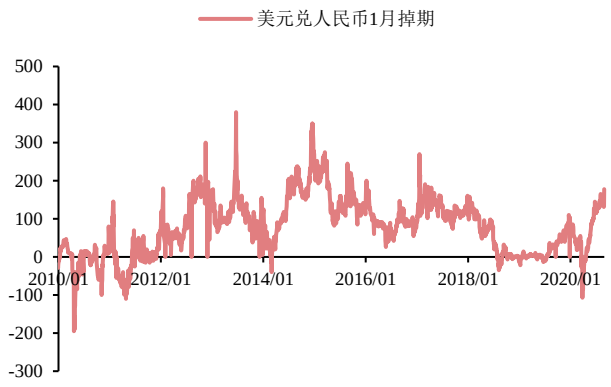
人民币掉期

图 27：美元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



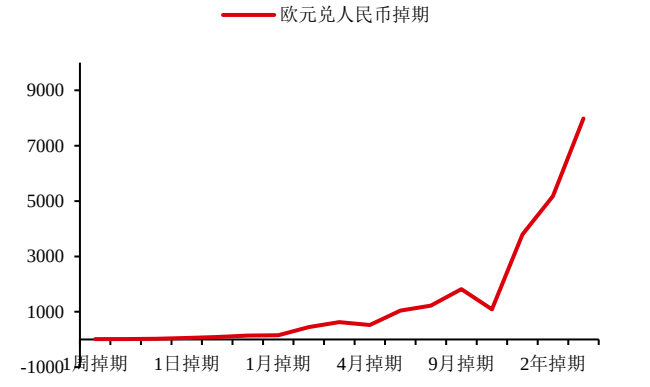
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

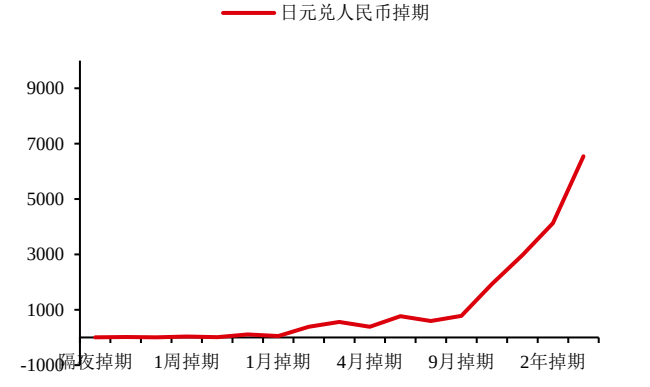


图 32：日元兑人民币 1 月掉期 单位：无

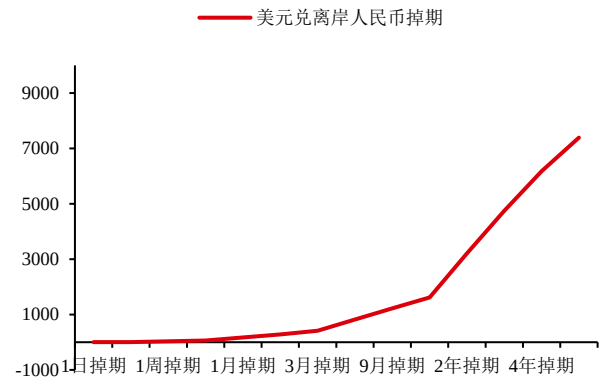


数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



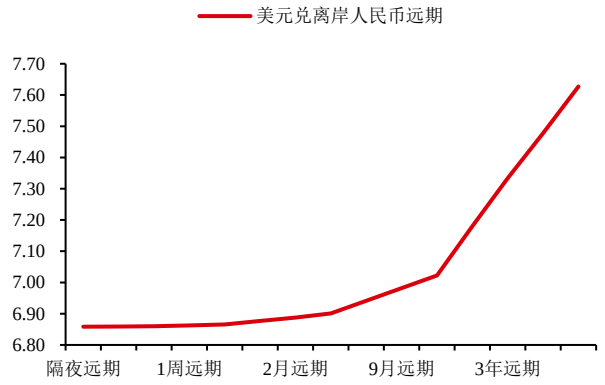
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 34： 美元兑离岸人民币 1 月远期 单位：无



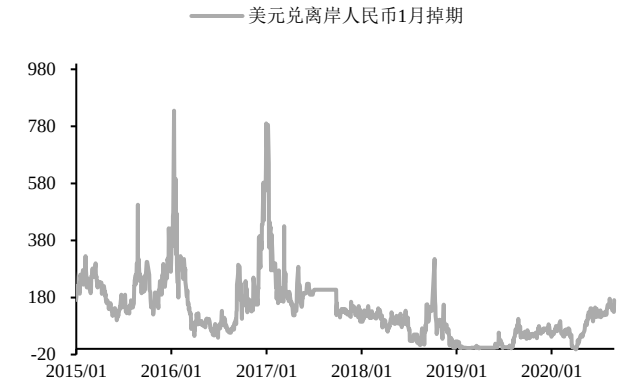
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

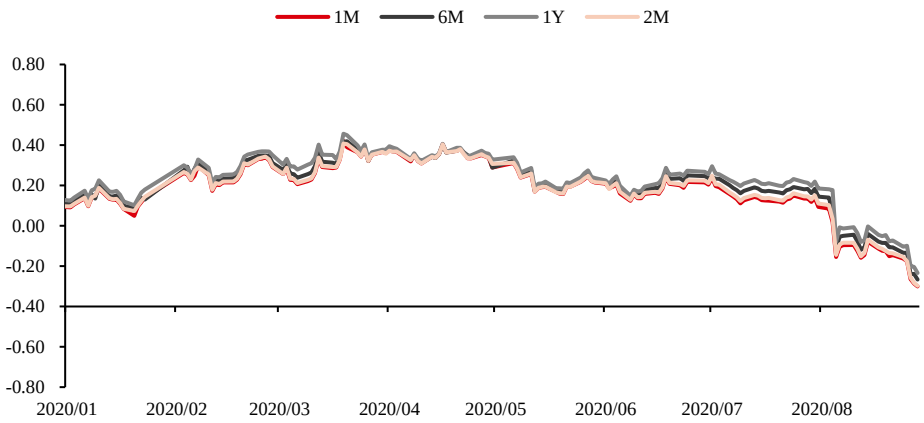
图 36： 美元兑离岸人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

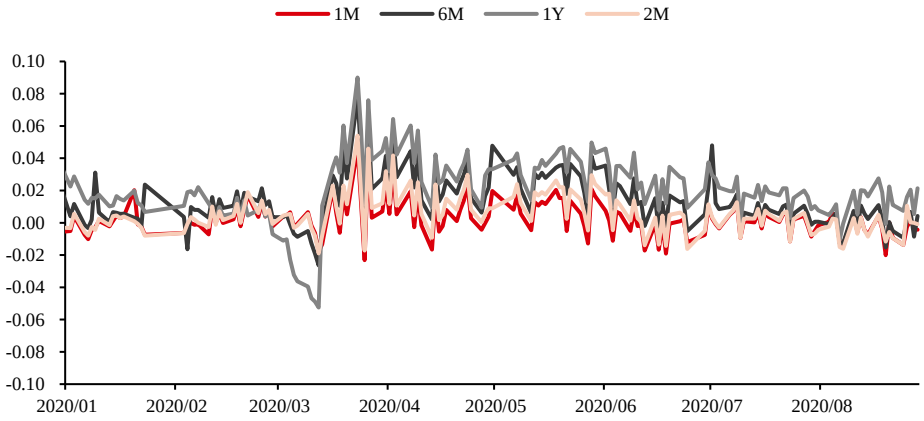
外汇价差

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



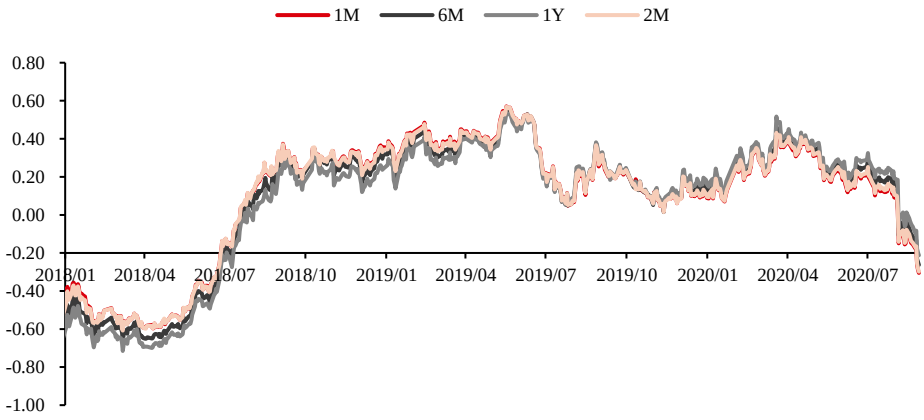
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

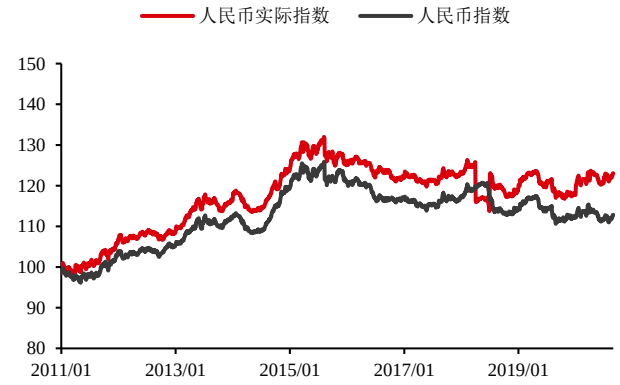
图 39： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

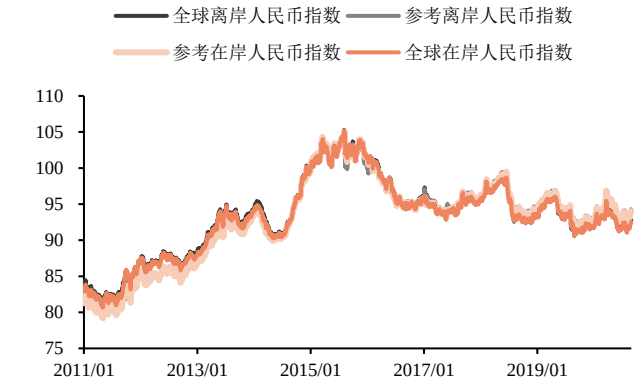
外汇指数

图 40： 国证人民币指数 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

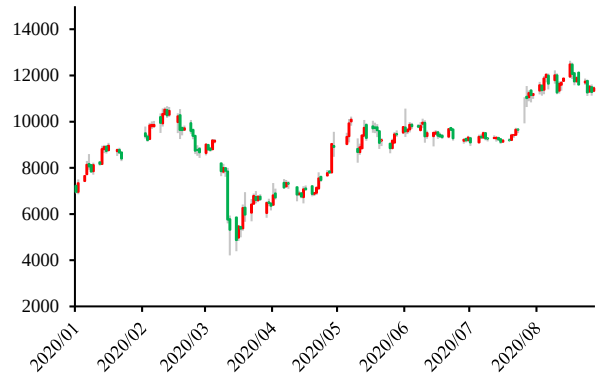
图 41： RXY 人民币指数 单位：无



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



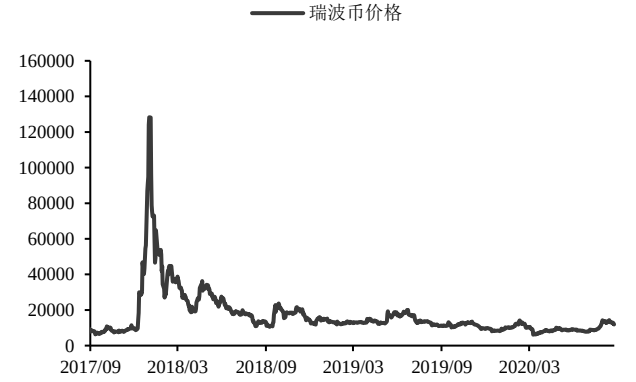
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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