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

汇总：

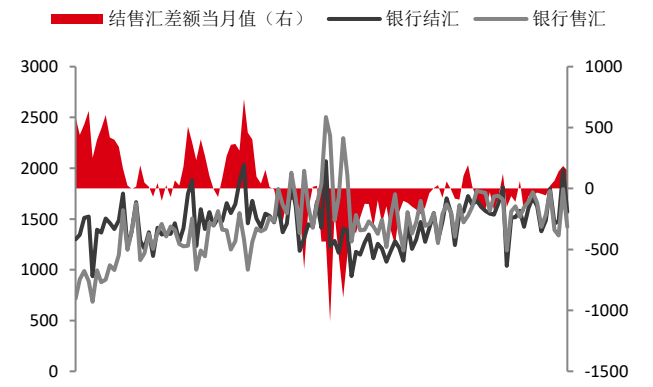
重要外汇期货合约走势	2020-06-12	2020-06-05	周变动
CME 欧元兑美元	1.1239	1.1294	-0.49%
HKEX 美元兑人民币期货	7.0726	7.0908	-0.26%
CME 墨西哥比索兑美元	0.045	0.0463	-2.81%
CME 澳元兑美元	0.6869	0.6969	-1.43%
CME 加元兑美元	0.7353	0.7454	-1.35%
CME 英镑兑美元	1.255	1.2668	-0.93%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1979	0.2013	-1.69%
CME 欧元兑美元	1.1239	1.1294	-0.49%
CME 卢布兑美元	0.0144	0.0146	-1.37%
CME 新西兰元兑美元	0.6462	0.6509	-0.72%
ICE 美元指数期货	97.703	96.938	0.79%

美元汇率变动	2020-06-12	2020-06-05	周变动
美元指数	97.1012	96.9357	0.17%
欧元兑美元	1.1256	1.1284	-0.25%
美元兑日元	107.38	109.58	-2.01%
英镑兑美元	1.2542	1.2665	-0.97%
美元兑加元	1.3586	1.3422	1.22%
澳元兑美元	0.6867	0.6969	-1.46%
新西兰元兑美元	0.6424	0.6509	-1.31%
美元兑瑞郎	0.9524	0.9624	-1.04%
美元兑港币	7.7501	7.7502	0.00%
美元兑新台币	29.6435	29.69	-0.16%

人民币中间价	2020-06-12	2020-06-05	周变动
美元中间价	7.0865	7.0965	-0.14%
欧元中间价	8.0036	8.0476	-0.55%
日元中间价	0.0664	0.0650	2.17%
英镑中间价	8.9139	8.9471	-0.37%
泰铢中间价	0.2280	0.2251	1.29%
港币中间价	0.9143	0.91566	-0.15%
林吉特中间价	0.59993	0.6013	-0.23%
俄罗斯卢布中间价	9.9059	9.715	1.97%
澳元中间价	4.8431	4.9284	-1.73%
加元中间价	5.1987	5.2589	-1.14%
新西兰元中间价	4.5479	4.5907	-0.93%
新加坡元中间价	5.0837	5.0773	0.13%
瑞郎中间价	7.5107	7.4295	1.09%
兰特中间价	2.4275	2.3821	1.91%
韩元中间价	170.05	171.48	-0.83%
沙特里亚尔中间价	0.52915	0.52916	0.00%
迪拉姆中间价	0.51794	0.51762	0.06%
波兰兹罗提中间价	0.55814	0.55108	1.28%
丹麦克朗中间价	0.9312	0.9262	0.54%
匈牙利福林中间价	43.176	42.8287	0.81%
墨西哥比索中间价	3.2234	3.0858	4.46%
土耳其里拉中间价	0.96413	0.95188	1.29%
挪威克朗中间价	1.3597	1.3168	3.26%
瑞典克朗中间价	1.3167	1.2954	1.64%

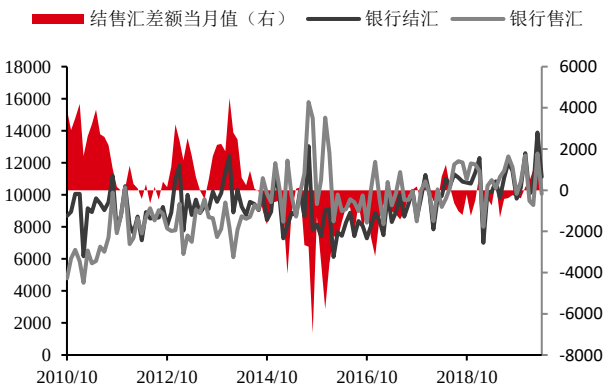
银行结售汇情况

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

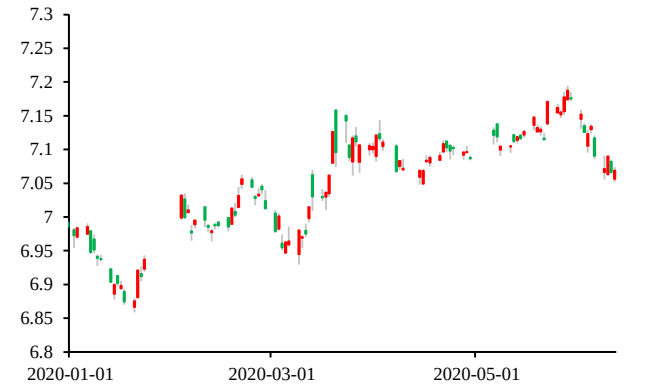
图 2： 银行结售汇情况-人民币 单位：亿元



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



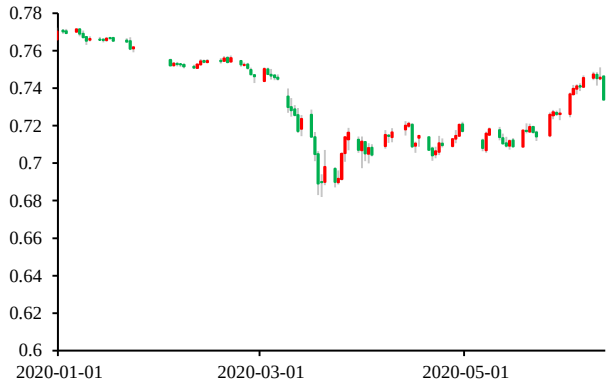
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 4： 美元指数期货 2006 合约走势 单位：无



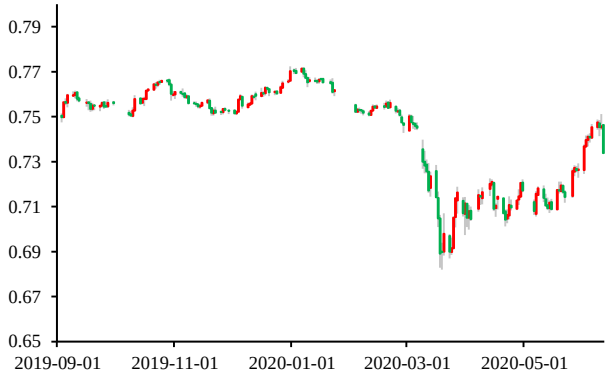
数据来源：Bloomberg 华泰期货研究院

图 5： CME 加元兑美元活跃合约 单位：无



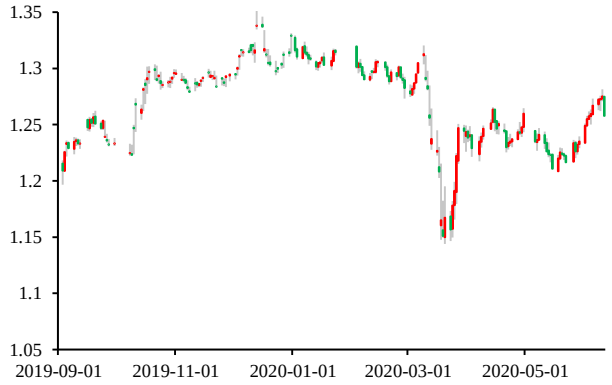
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 6： CME 日元兑美元活跃合约 单位：无



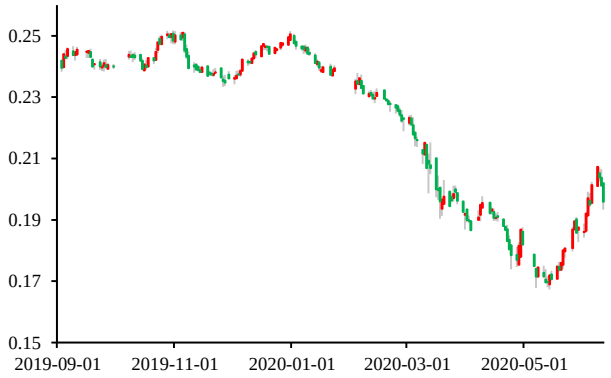
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 7： CME 英镑兑美元活跃合约 单位：无



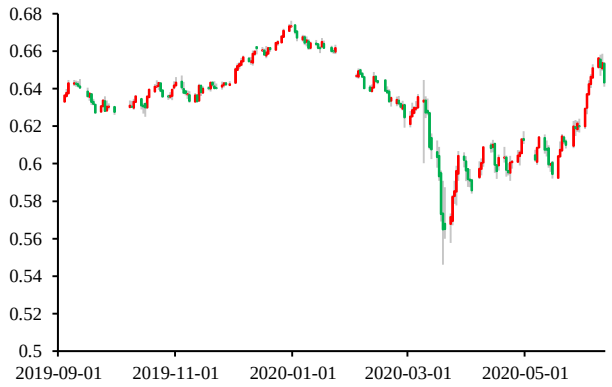
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 8： CME 巴西雷亚尔兑美元活跃合约 单位：无



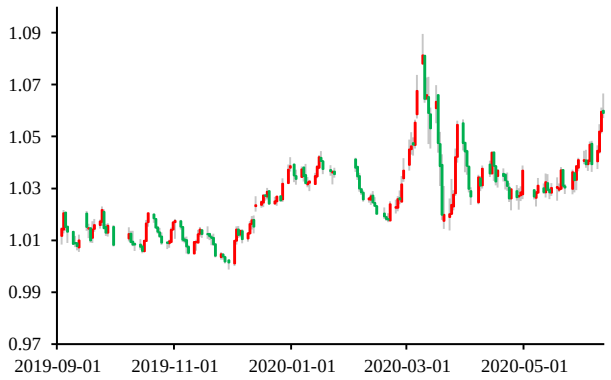
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



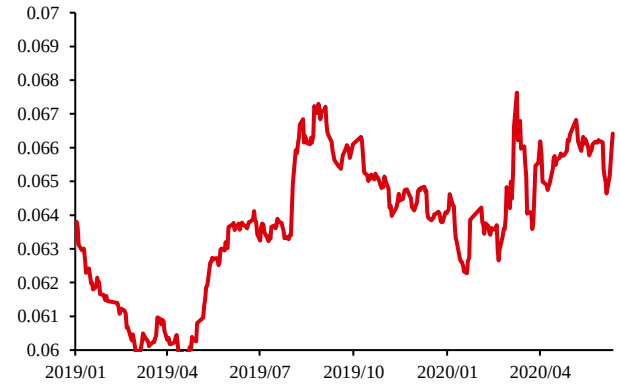
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

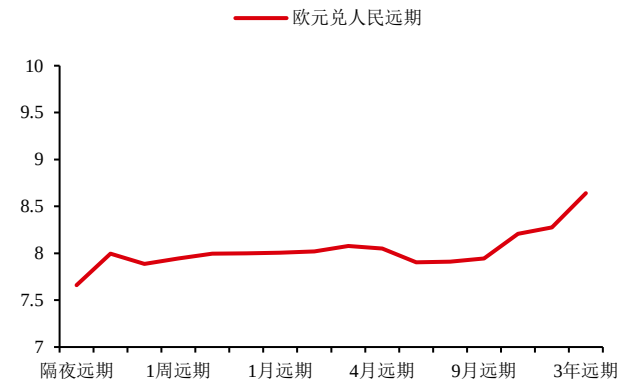
图 20：英镑中间价 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

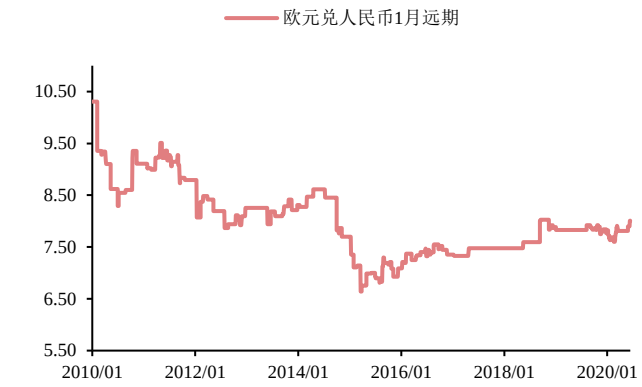
人民币远期

图 21： 欧元兑人民币远期-不同期限 单位：无



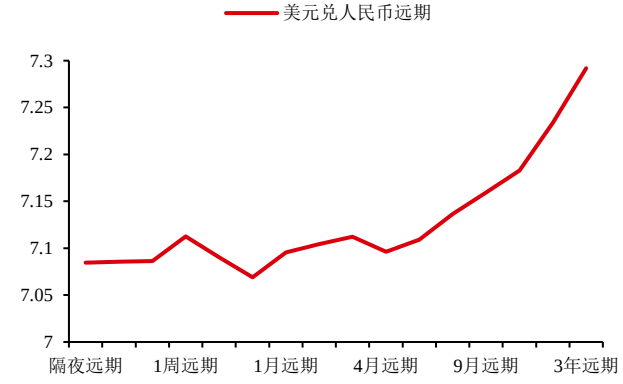
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



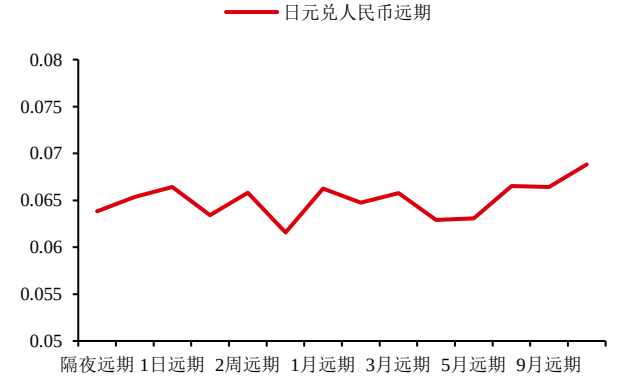
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 24： 美元兑人民币 1 月远期 单位：无



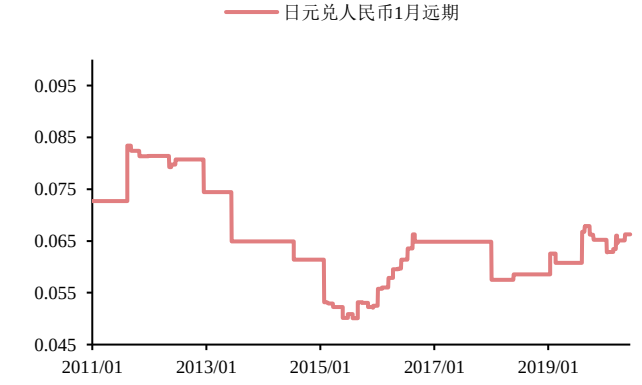
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

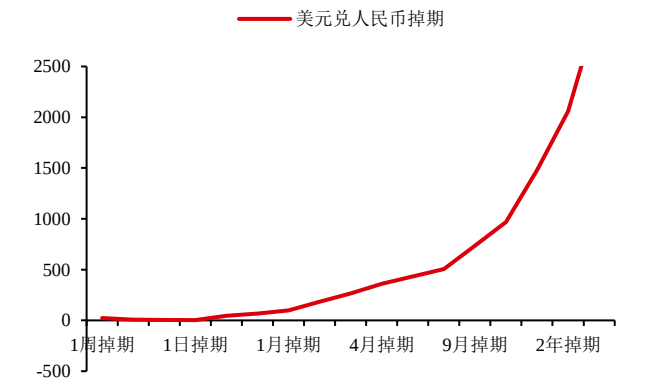
图 26： 日元兑人民币 1 月远期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

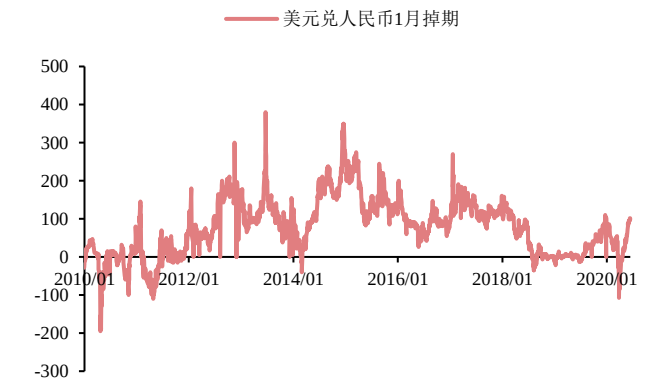
人民币掉期

图 27：美元兑人民币掉期-不同期限 单位：无



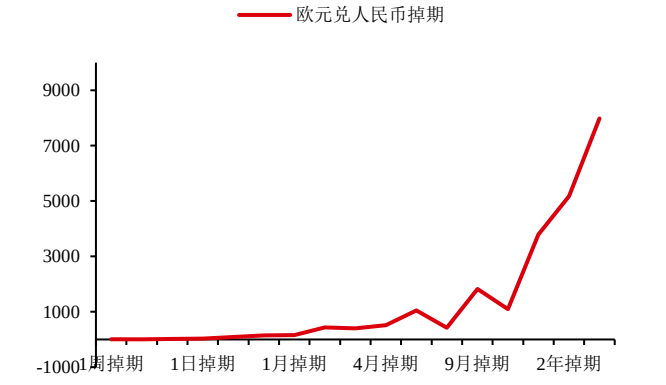
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 28：美元兑人民币 1 月掉期 单位：无



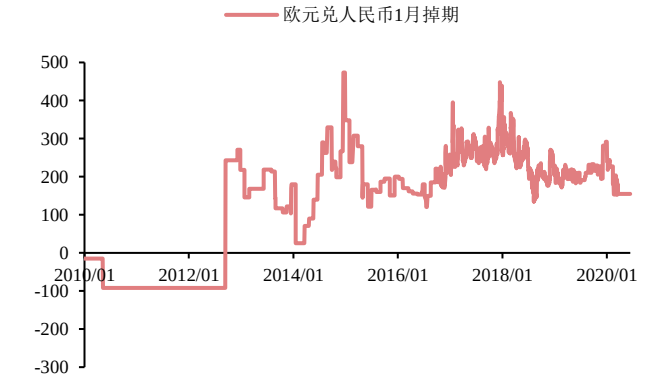
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

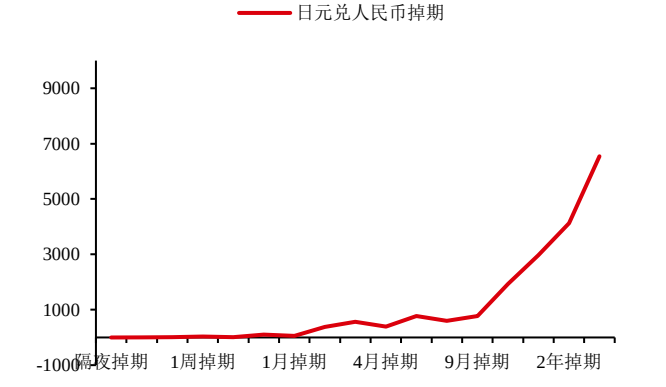
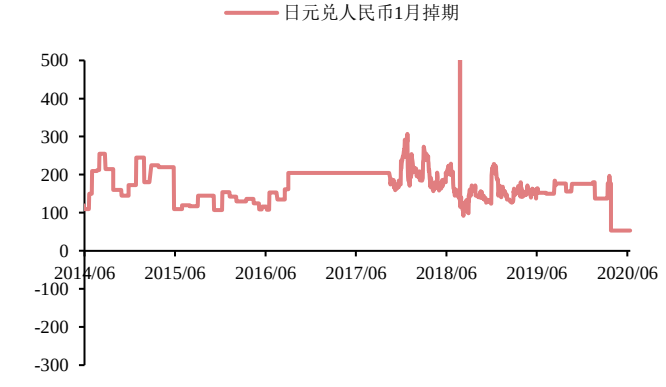


图 32：日元兑人民币 1 月掉期 单位：无

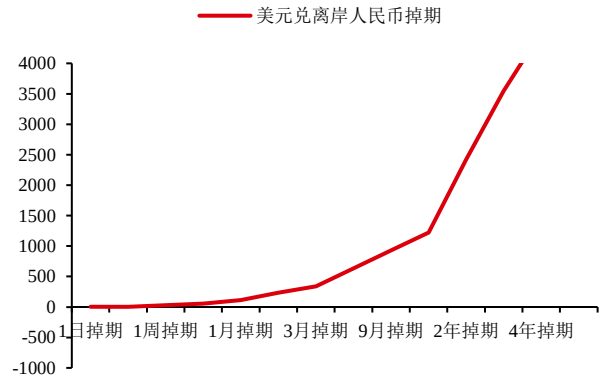


数据来源：Wind 华泰期货研究院

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



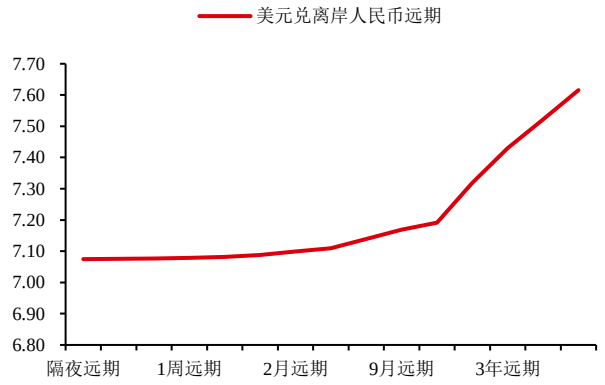
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 34：美元兑离岸人民币 1 月远期 单位：无



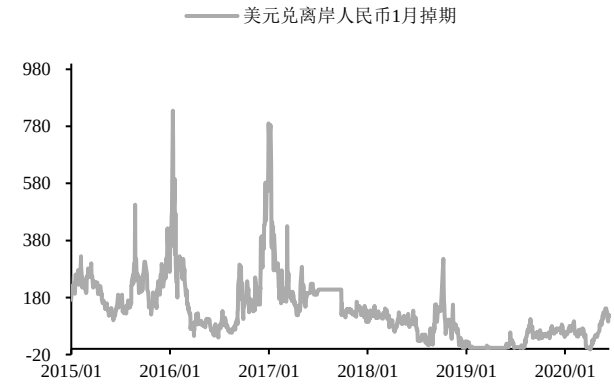
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

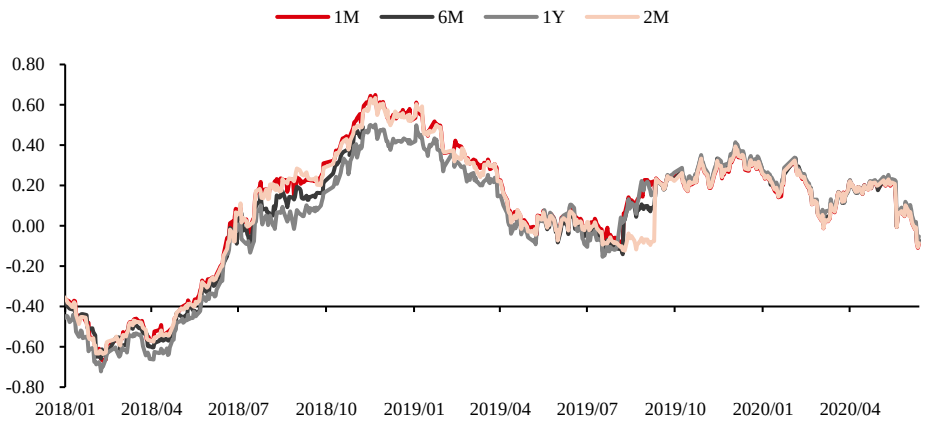
图 36：美元兑离岸人民币 1 月掉期 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

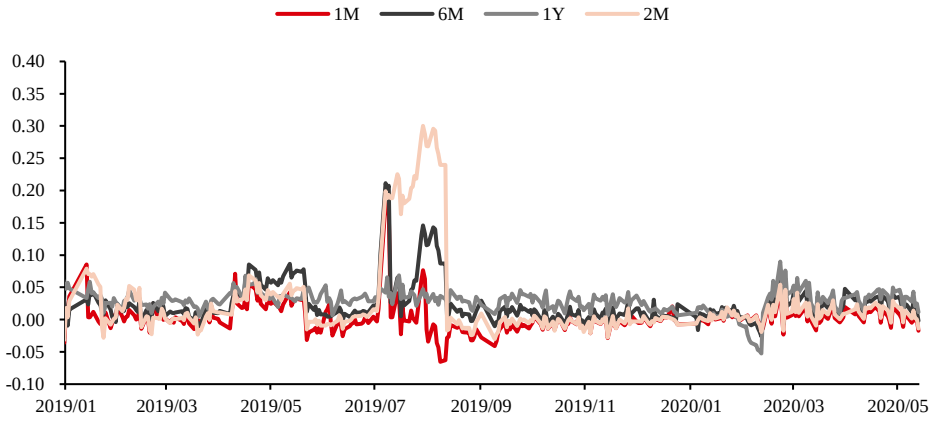
外汇价差

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



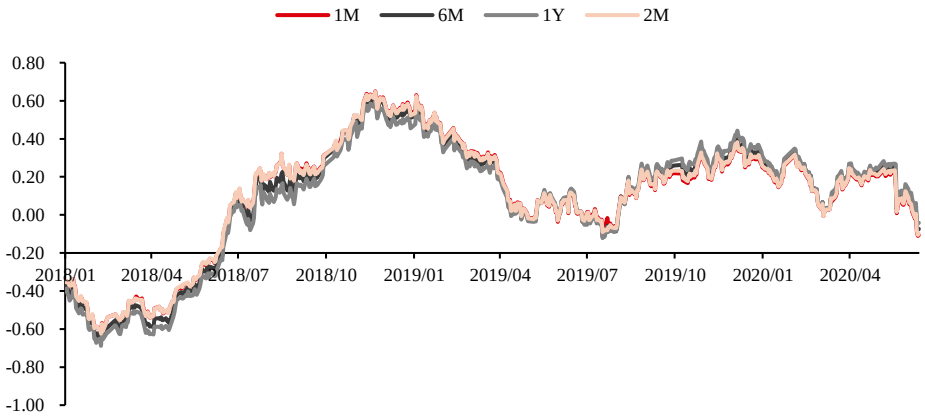
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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

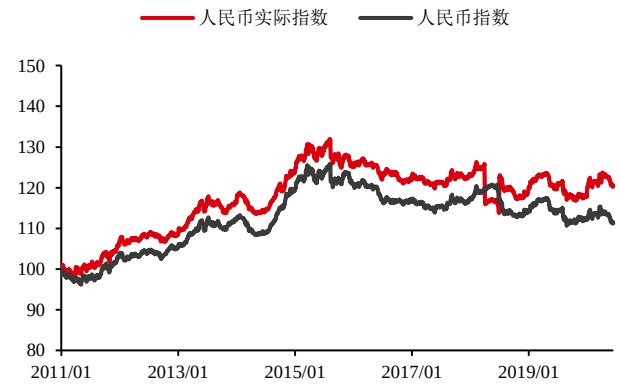
图 39： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

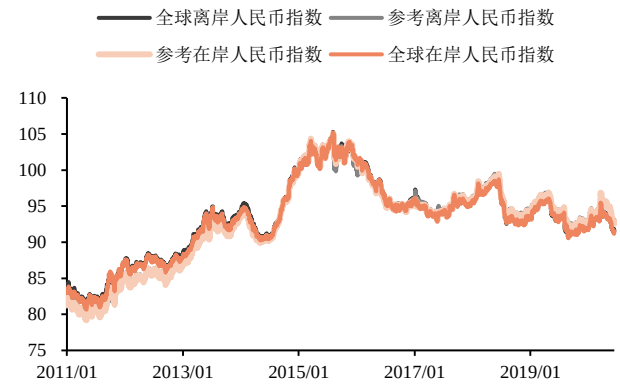
外汇指数

图 40： 国证人民币指数 单位：无



数据来源：Wind 华泰期货研究院

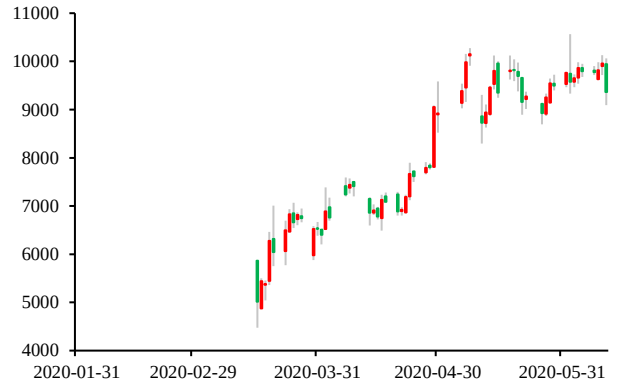
图 41： RXY 人民币指数 单位：无



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



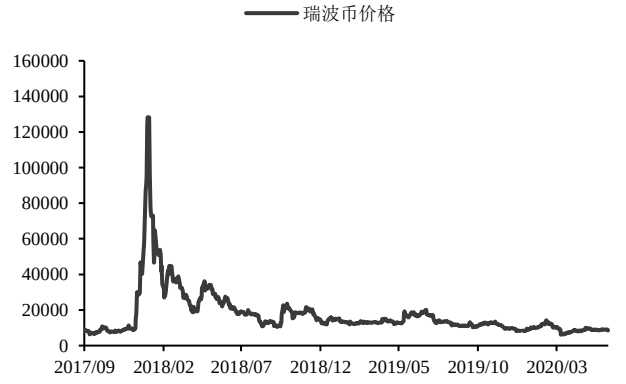
数据来源：Wind 华泰期货研究院

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