



外汇数据跟踪周报

汇总:

重要外汇期货合约走势	2021-11-12	2021-11-05	周变动
CME 欧元兑美元	1.145	1.1577	-1.10%
HKEX 美元兑人民币期货	6.397	6.4159	-0.29%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0485	0.0489	-0.82%
CME 澳元兑美元	0.7332	0.7406	-1.00%
CME 加元兑美元	0.7967	0.8028	-0.76%
CME 英镑兑美元	1.3409	1.3495	-0.64%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1828	0.1797	1.73%
CME 欧元兑美元	1.145	1.1577	-1.10%
CME 卢布兑美元	0.0136	0.014	-2.86%
CME 新西兰元兑美元	0.7036	0.7119	-1.17%
ICE 美元指数期货	94.993	94.207	0.83%

美元汇率变动	2021-11-12	2021-11-05	周变动
美元指数	95.1166	94.2241	0.95%
欧元兑美元	1.1444	1.1568	-1.07%
美元兑日元	113.91	113.4	0.45%
英镑兑美元	1.3415	1.3499	-0.62%
美元兑加元	1.2547	1.2456	0.73%
澳元兑美元	0.7333	0.7403	-0.95%
新西兰元兑美元	0.7043	0.7117	-1.04%
美元兑瑞郎	0.9212	0.9122	0.99%
美元兑港币	7.7907	7.7831	0.10%
美元兑新台币	27.831	27.879	-0.17%

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

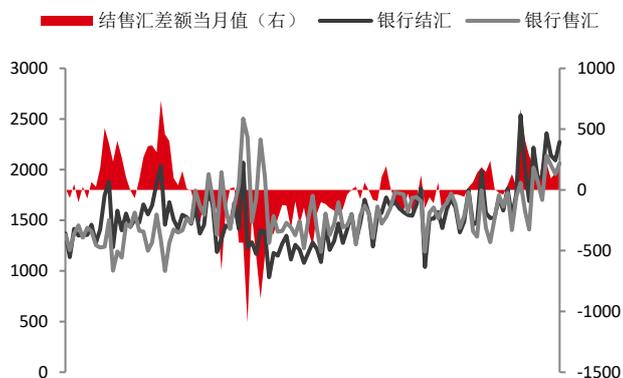
✉ pengxin@htfc.com

从业资格号: F3066607

人民币中间价	2021-11-12	2021-11-05	周变动
美元中间价	6.4065	6.398	0.13%
欧元中间价	7.3338	7.3903	-0.76%
日元中间价	0.0562	0.0562	-0.08%
英镑中间价	8.5633	8.6386	-0.87%
泰铢中间价	0.1950	0.1918	1.68%
港币中间价	0.82229	0.82203	0.03%
林吉特中间价	0.65072	0.64953	0.18%
俄罗斯卢布中间价	11.1901	11.17	0.18%
澳元中间价	4.6703	4.7368	-1.40%
加元中间价	5.0894	5.1375	-0.94%
新西兰元中间价	4.4955	4.5449	-1.09%
新加坡元中间价	4.7303	4.736	-0.12%
瑞郎中间价	6.953	7.0097	-0.81%
兰特中间价	2.3908	2.3779	0.54%
韩元中间价	184.52	185.34	-0.44%
沙特里亚尔中间价	0.58542	0.5863	-0.15%
迪拉姆中间价	0.57331	0.57408	-0.13%
波兰兹罗提中间价	0.6319	0.62266	1.48%
丹麦克朗中间价	1.0141	1.0062	0.79%
匈牙利福林中间价	49.7592	48.6996	2.18%
墨西哥比索中间价	3.2211	3.213	0.25%
土耳其里拉中间价	1.54883	1.51631	2.14%
挪威克朗中间价	1.3554	1.3368	1.39%
瑞典克朗中间价	1.36	1.3424	1.31%

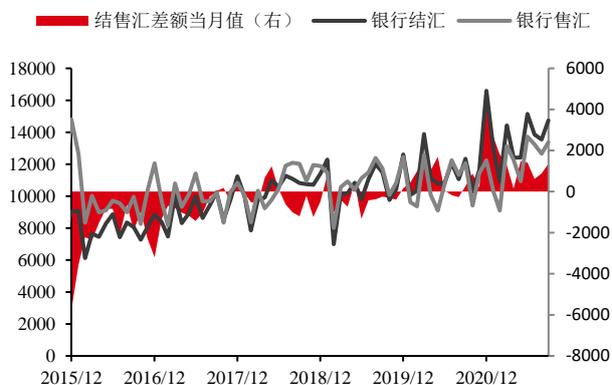
银行结售汇情况

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

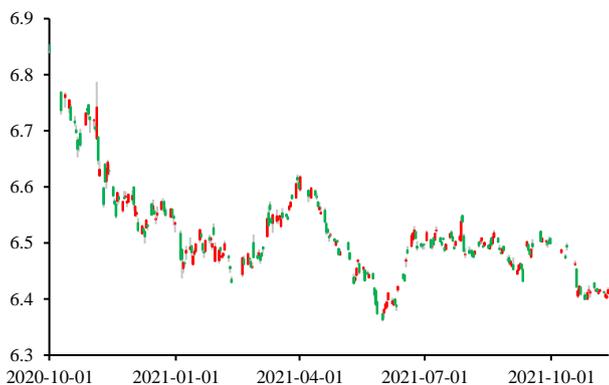
图 2: 银行结售汇情况-人民币 单位: 亿元



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: 美元指数期货活跃合约走势 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



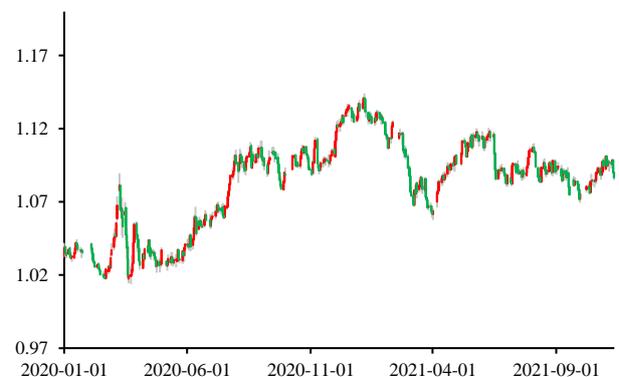
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



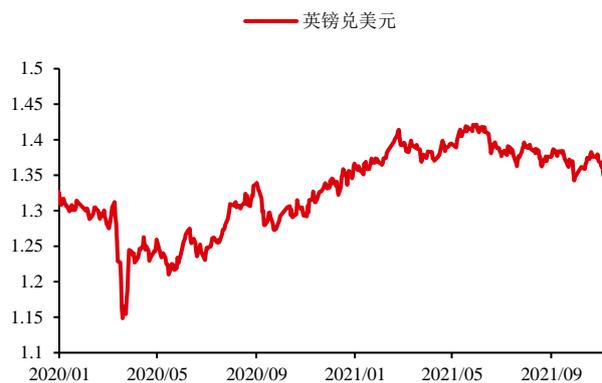
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

人民币中间价

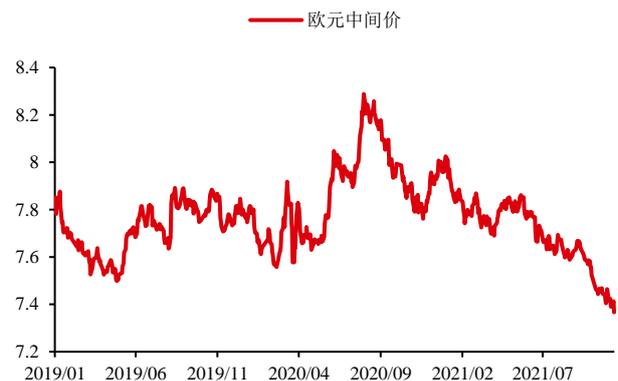
图 17: 美元中间价 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

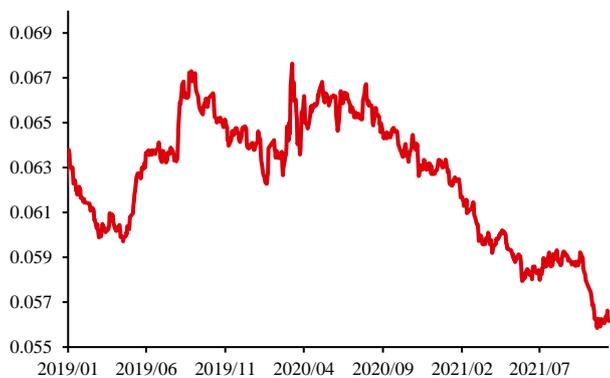
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

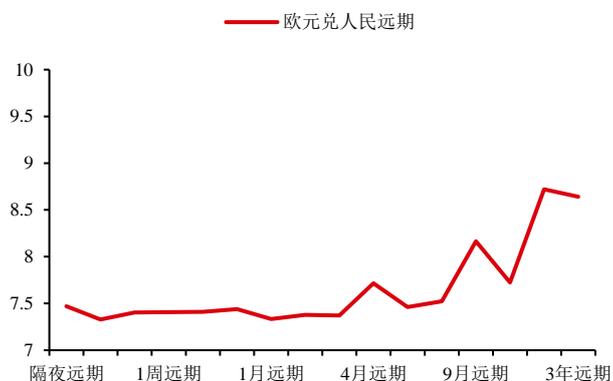
图 20: 英镑中间价 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

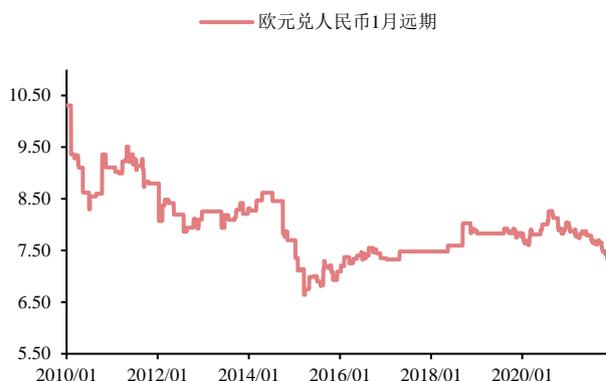
人民币远期

图 21: 欧元兑人民币远期-不同期限 单位: 无



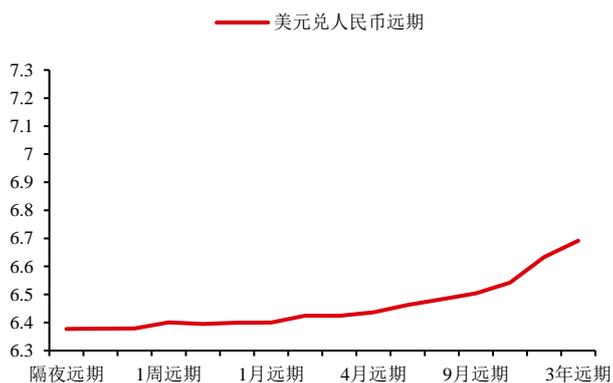
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



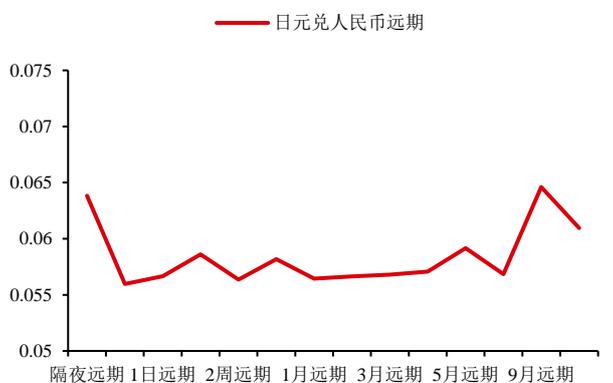
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

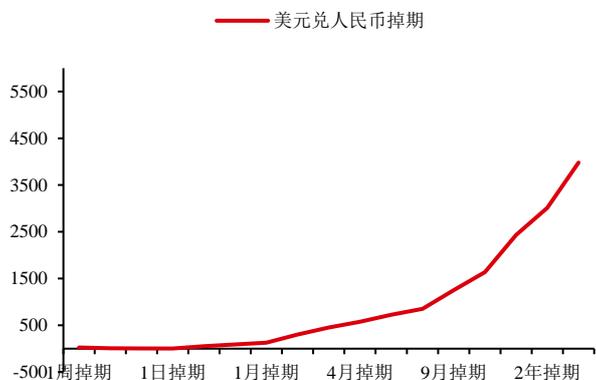
图 26: 日元兑人民币 1 月远期 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

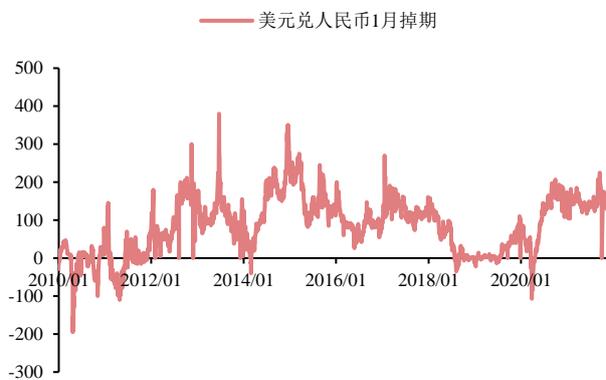
人民币掉期

图 27: 美元兑人民币掉期-不同期限 单位: 无



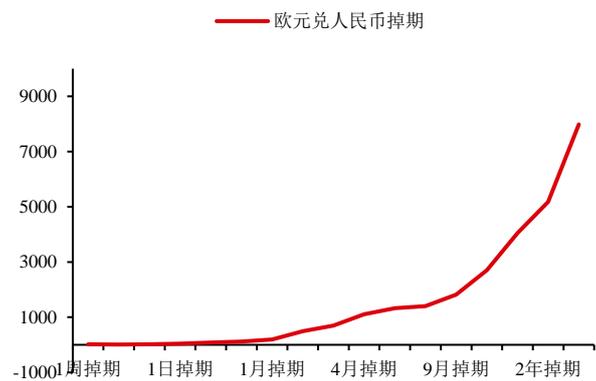
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 28: 美元兑人民币 1 月掉期 单位: 无



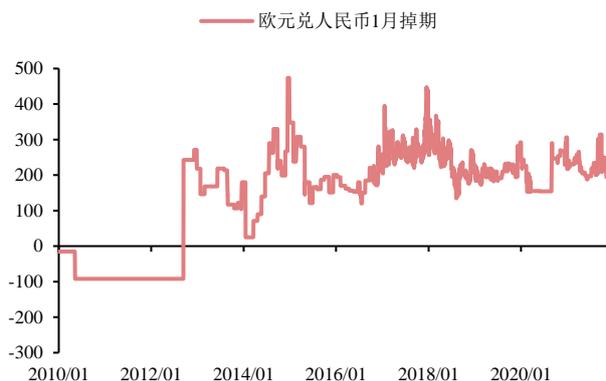
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

预览已结束, 完整报告链接和二维码如下:

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_1423



云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn