



## 外汇数据跟踪周报

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%

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

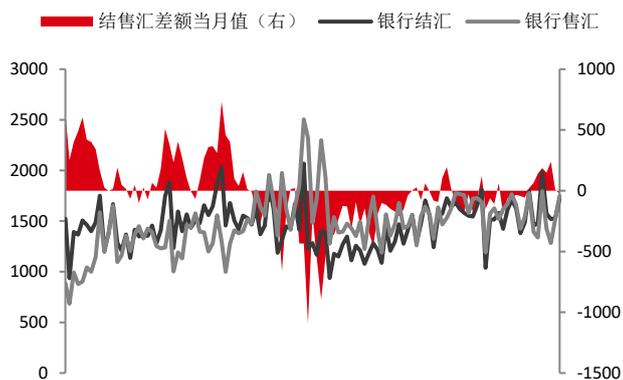
✉ pengxin@htfc.com

从业资格号: F3066607

人民币中间价	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%

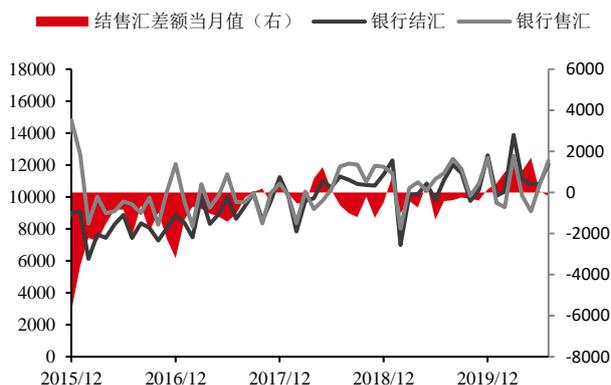
### 银行结售汇情况

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



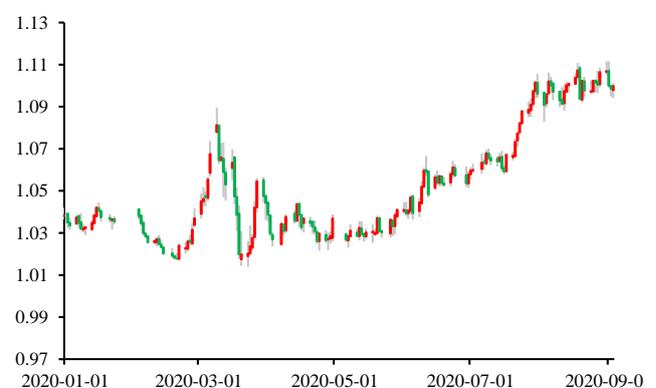
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

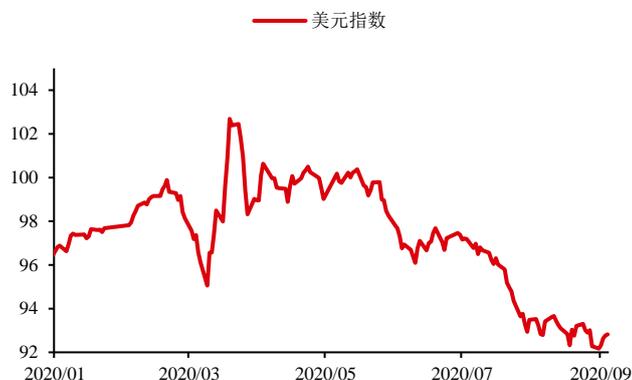
图 10: CME 瑞郎兑美元活跃合约 单位: 无



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



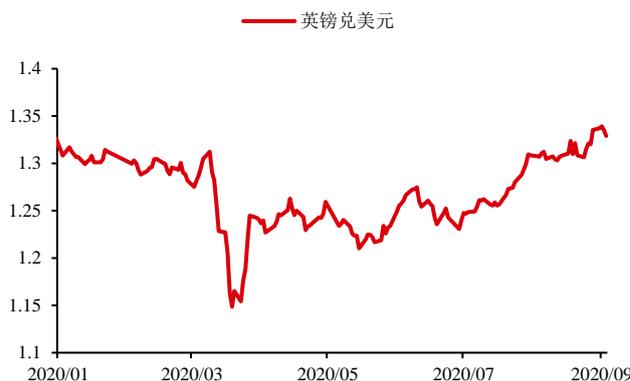
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

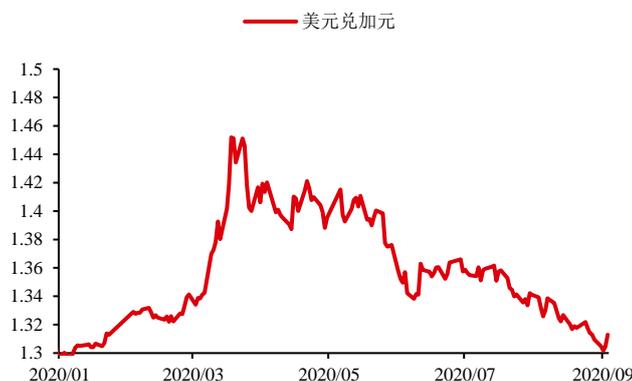


图 16: 澳元兑美元 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

### 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

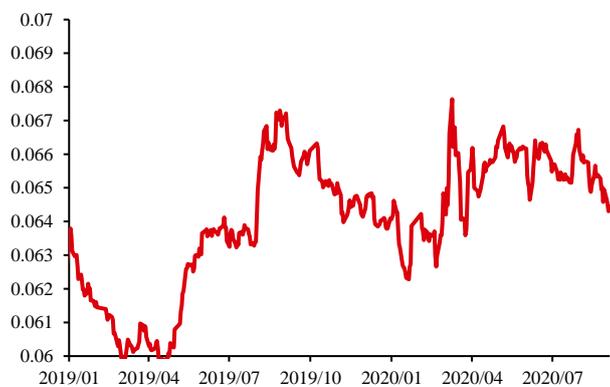
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

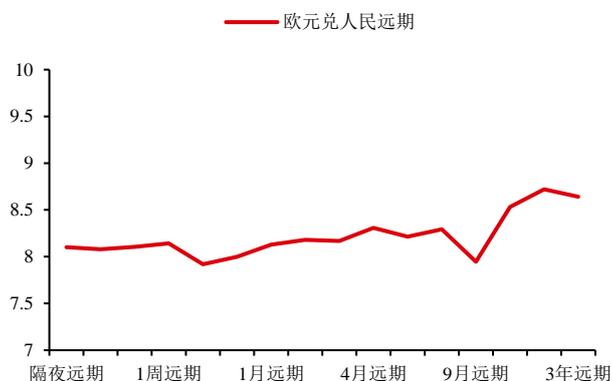
图 20: 英镑中间价 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

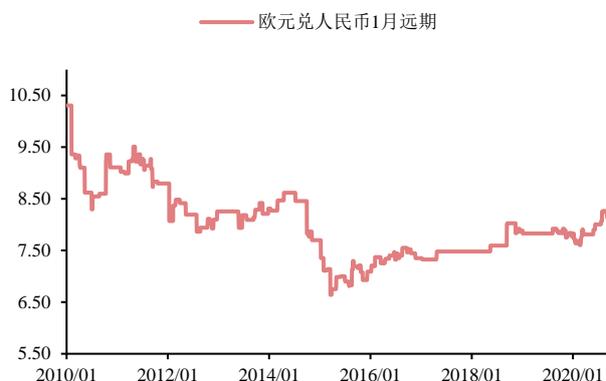
### 人民币远期

图 21: 欧元兑人民币远期-不同期限 单位: 无



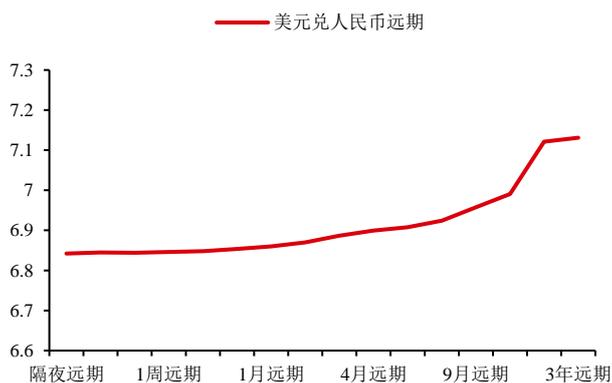
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



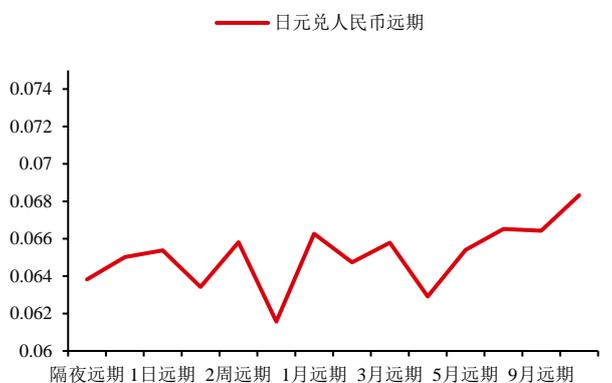
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

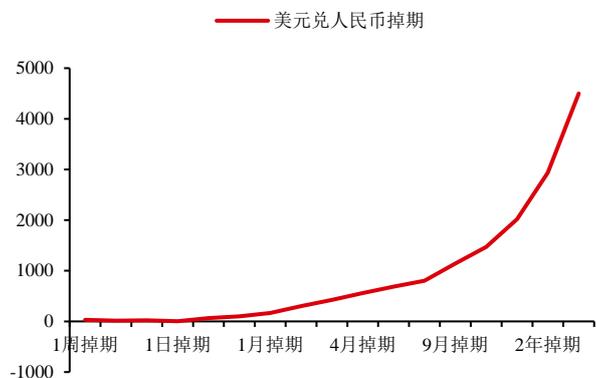
图 26: 日元兑人民币 1 月远期 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

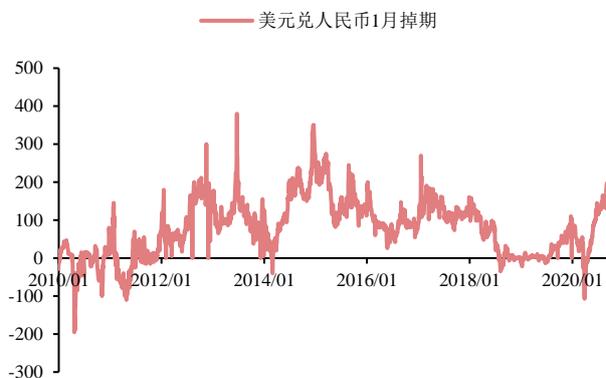
## 人民币掉期

图 27: 美元兑人民币掉期-不同期限 单位: 无



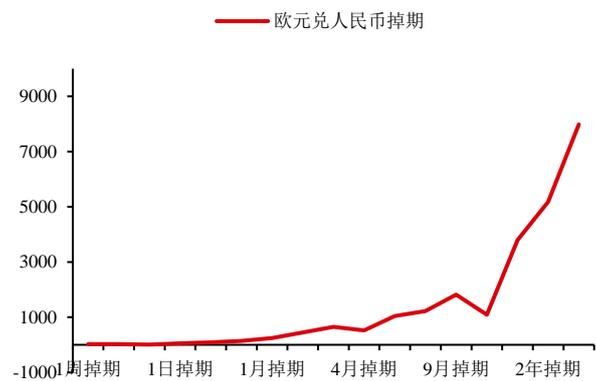
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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\\_2732](https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_2732)



云报告  
https://www.yunbaogao.cn

云报告  
https://www.yunbaogao.cn

云报告  
https://www.yunbaogao.cn