

外汇数据跟踪周报

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%

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

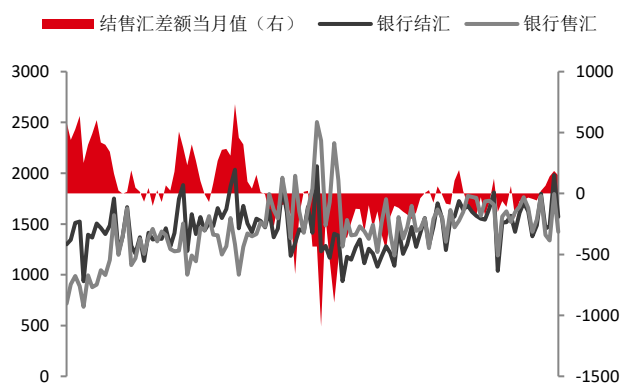
✉ gaocong@htfc.com

从业资格号: F3063338

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%

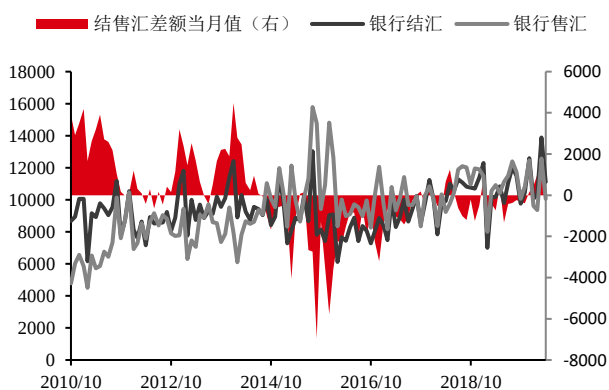
银行结售汇情况

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

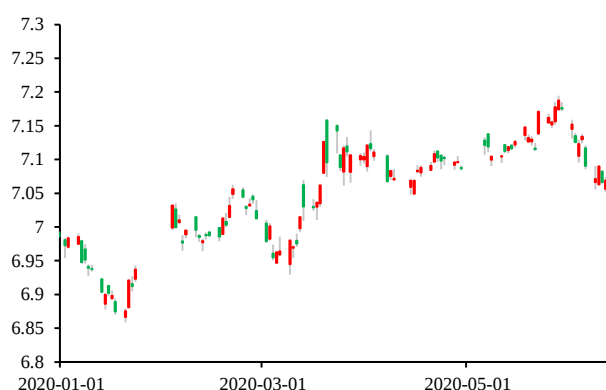
图 2: 银行结售汇情况-人民币 单位: 亿元



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



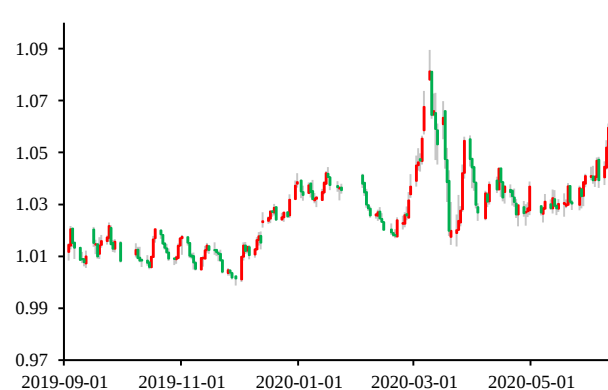
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

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

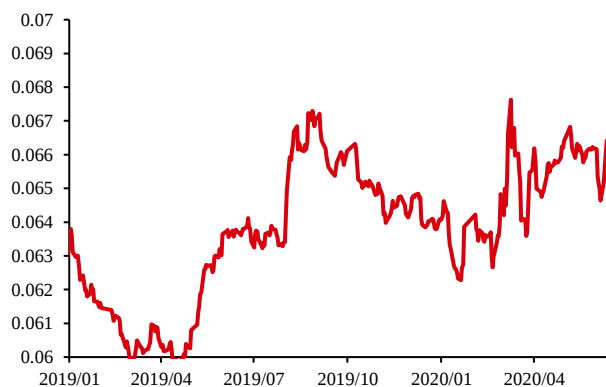
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

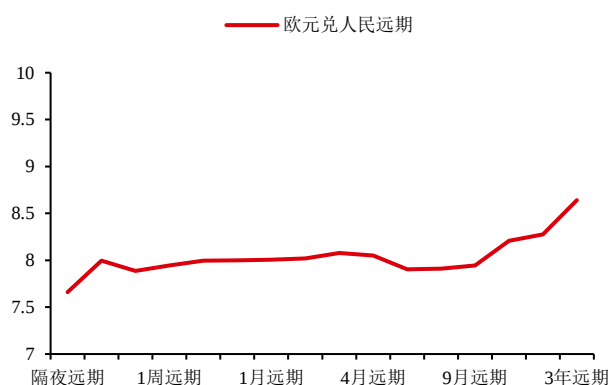
图 20: 英镑中间价 单位: 无



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



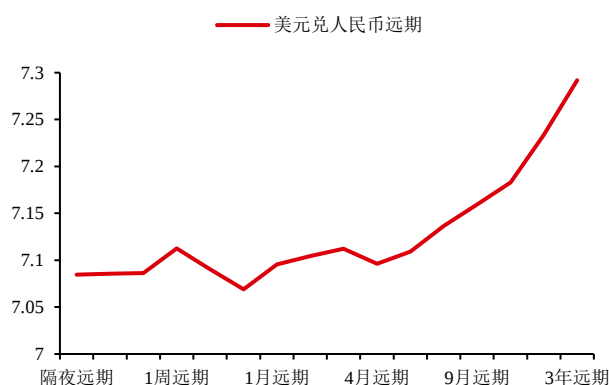
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



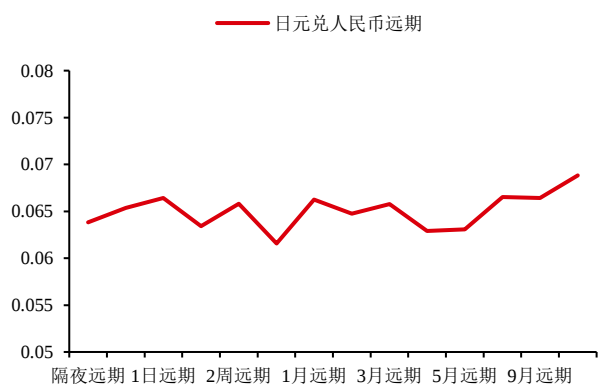
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 24: 美元兑人民币 1 月远期 单位: 无



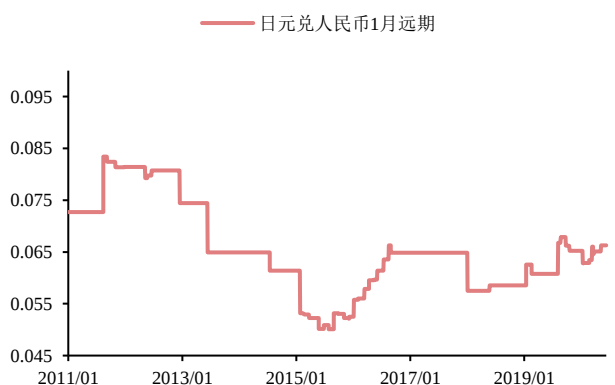
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

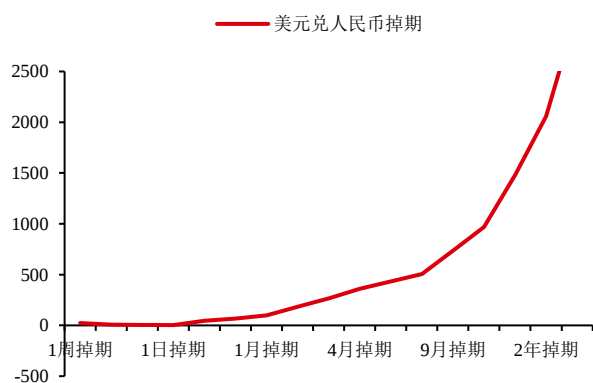
图 26: 日元兑人民币 1 月远期 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

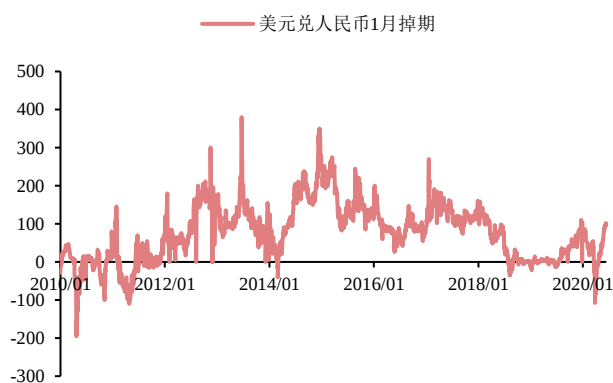
人民币掉期

图 27: 美元兑人民币掉期-不同期限 单位: 无



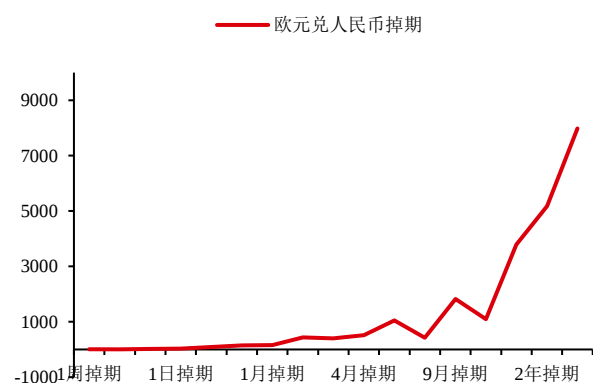
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 28: 美元兑人民币 1 月掉期 单位: 无



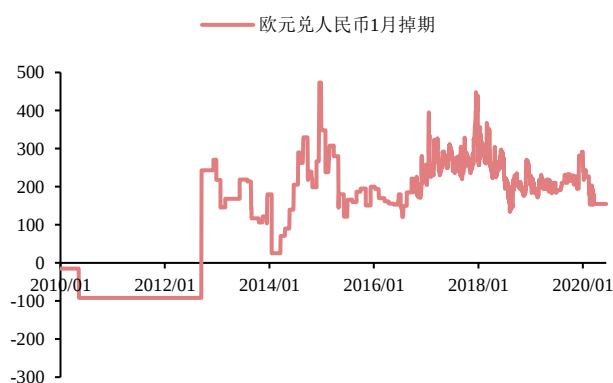
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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_4508

