

## 外汇数据跟踪周报

中央编号: BHE003

汇总:

研究员

臧睿哲 Racer Zang

CE No.: BQS096

[ruizhe.zang@htfc.com.hk](mailto:ruizhe.zang@htfc.com.hk)

机构销售

陈伯龙 Elf Chen

CE. No.: APJ189

[elfchen@htfc.com.hk](mailto:elfchen@htfc.com.hk)

扫描二维码, 关注我们



重要外汇期货合约走势	2021-07-09	2021-07-02	周变动
CME 欧元兑美元	1.1892	1.1882	0.08%
HKEX 美元兑人民币期货	6.5225	6.518	0.07%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0499	0.0502	-0.60%
CME 澳元兑美元	0.7494	0.7529	-0.46%
CME 加元兑美元	0.8036	0.8112	-0.94%
CME 英镑兑美元	1.391	1.3841	0.50%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1902	0.1971	-3.50%
CME 欧元兑美元	1.1892	1.1882	0.08%
CME 卢布兑美元	0.0134	0.0135	-0.74%
CME 新西兰元兑美元	0.7001	0.7031	-0.43%
ICE 美元指数期货	92.102	92.175	-0.08%

美元汇率变动	2021-07-09	2021-07-02	周变动
美元指数	92.1012	92.2452	-0.16%
欧元兑美元	1.1878	1.1866	0.10%
美元兑日元	110.115	111.01	-0.81%
英镑兑美元	1.3908	1.3829	0.57%



美元兑加元	1.2447	1.2326	0.98%
澳元兑美元	0.7489	0.7528	-0.52%
新西兰元兑美元	0.7004	0.7033	-0.41%
美元兑瑞郎	0.914	0.9204	-0.70%
美元兑港币	7.7681	7.7657	0.03%
美元兑新台币	27.966	27.955	0.04%

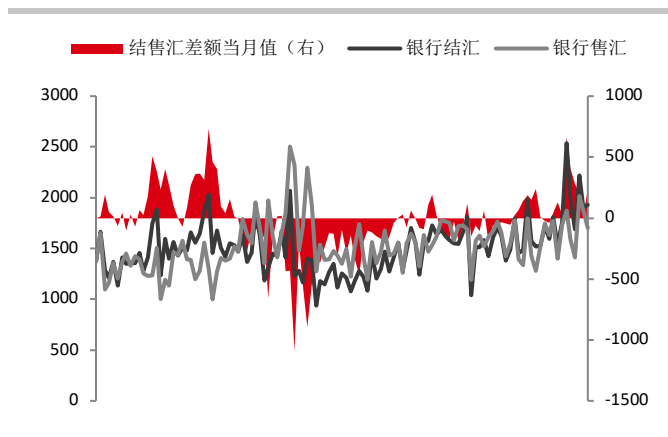
人民币中间价	2021-07-09	2021-07-02	周变动
美元中间价	6.4755	6.4712	0.07%
欧元中间价	7.6682	7.6634	0.06%
日元中间价	0.0590	0.0580	1.69%
英镑中间价	8.928	8.9031	0.28%
泰铢中间价	0.1992	0.2017	-1.25%
港币中间价	0.8336	0.83338	0.03%



林吉特中间价	0.64567	0.64286	0.44%
俄罗斯卢布中间价	11.5246	11.3505	1.53%
澳元中间价	4.8115	4.8301	-0.39%
加元中间价	5.1658	5.2004	-0.67%
新西兰元中间价	4.4979	4.5066	-0.19%
新加坡元中间价	4.7875	4.7947	-0.15%
瑞郎中间价	7.0776	6.9866	1.30%
兰特中间价	2.2109	2.235	-1.08%
韩元中间价	176.86	175.2	0.95%
沙特里亚尔中间价	0.57923	0.57965	-0.07%
迪拉姆中间价	0.5672	0.56768	-0.08%
波兰兹罗提中间价	0.59198	0.58918	0.48%
丹麦克朗中间价	0.9696	0.9703	-0.07%
匈牙利福林中间价	46.5877	45.8077	1.70%
墨西哥比索中间价	3.0873	3.0918	-0.15%
土耳其里拉中间价	1.34154	1.34058	0.07%
挪威克朗中间价	1.3572	1.3335	1.78%
瑞典克朗中间价	1.3277	1.3261	0.12%

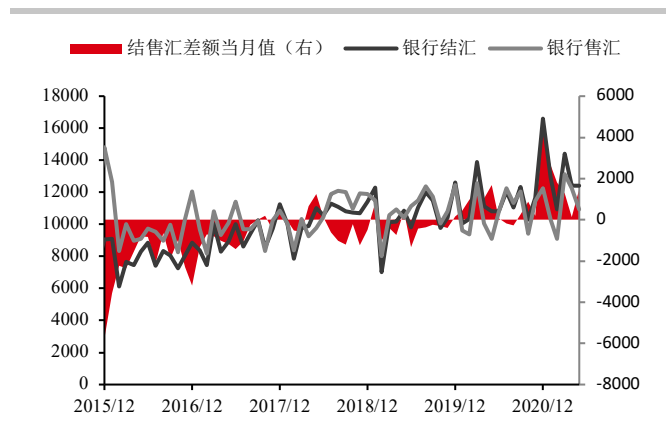
## 银行结售汇情况

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

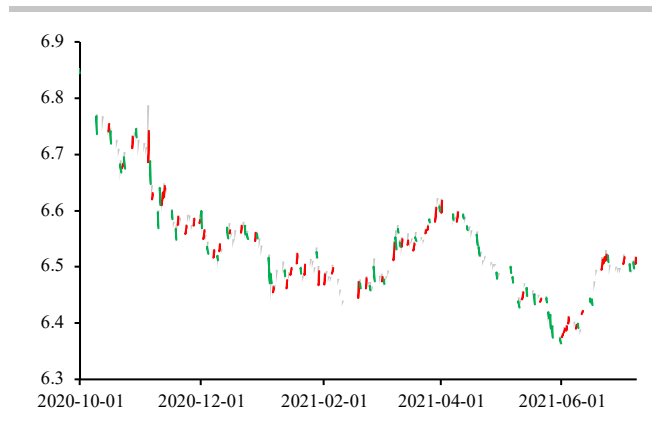
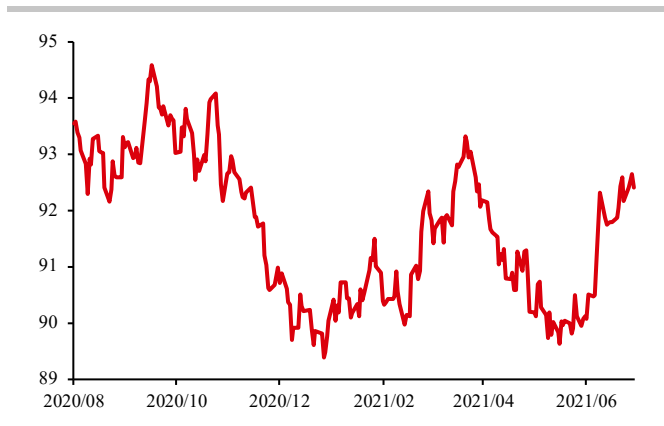


图 4: 美元指数期货活跃合约走势 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

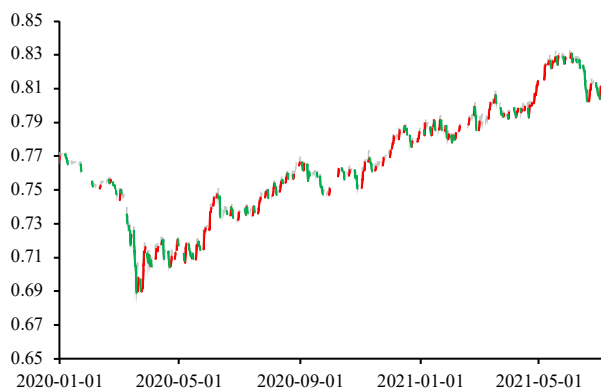
图 5: CME 加元兑美元活跃合约 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

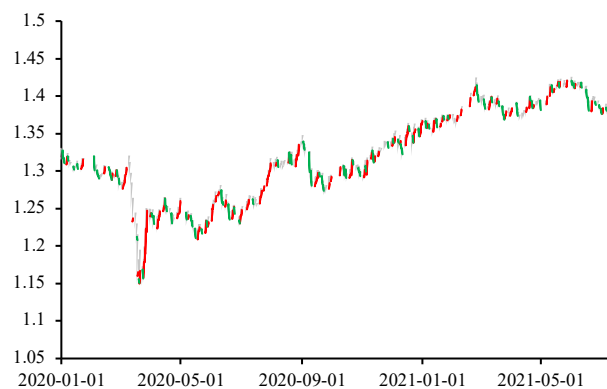
数据来源: Bloomberg 华泰期货研究院

图 6: CME 日元兑美元活跃合约 单位: 无



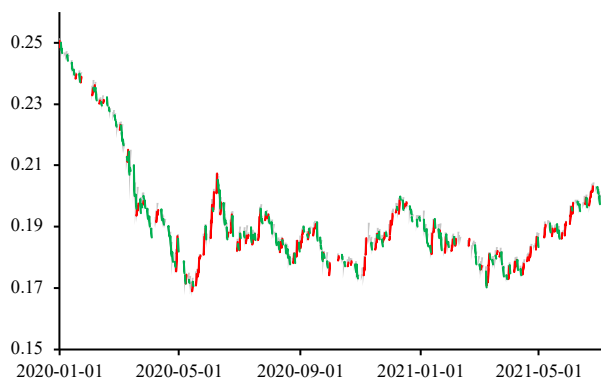
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 7: CME 英镑兑美元活跃合约 单位: 无



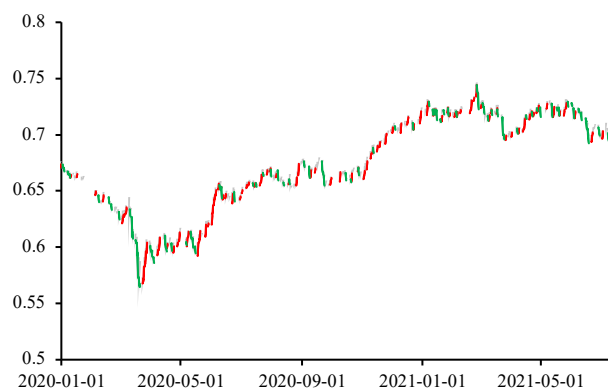
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

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

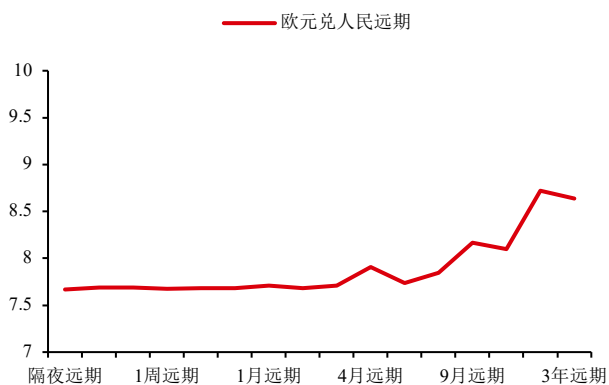


数据来源: Wind 华泰期货研究院

## 人民币远期



图 21: 欧元兑人民币远期-不同期限 单位: 无



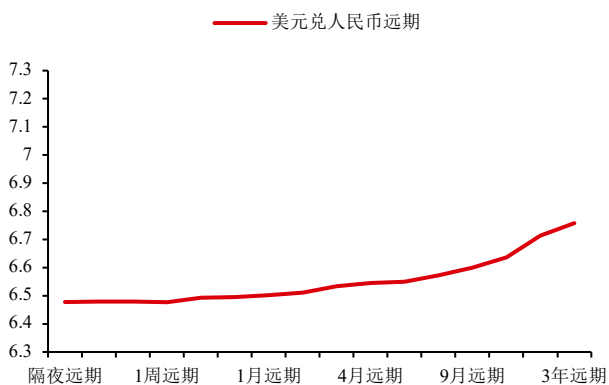
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



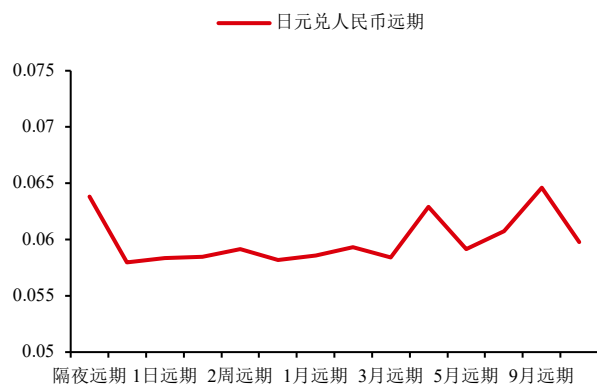
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 24: 美元兑人民币 1 月远期 单位: 无



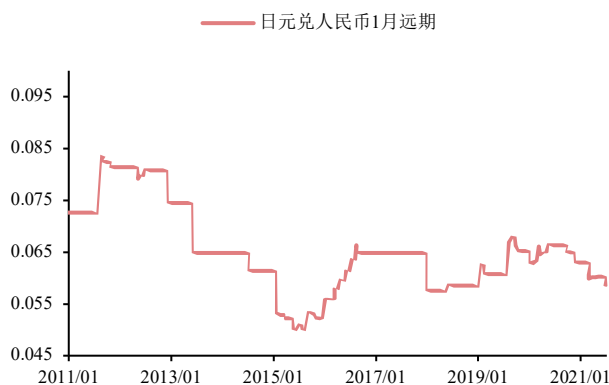
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

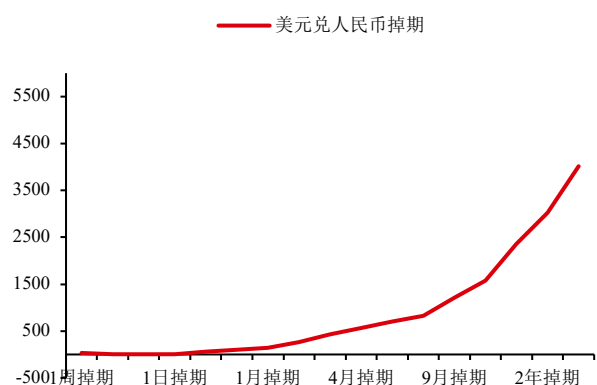
图 26: 日元兑人民币 1 月远期 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

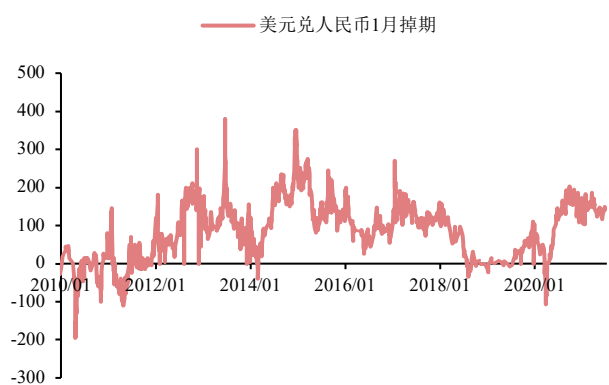
## 人民币掉期

图 27: 美元兑人民币掉期-不同期限 单位: 无



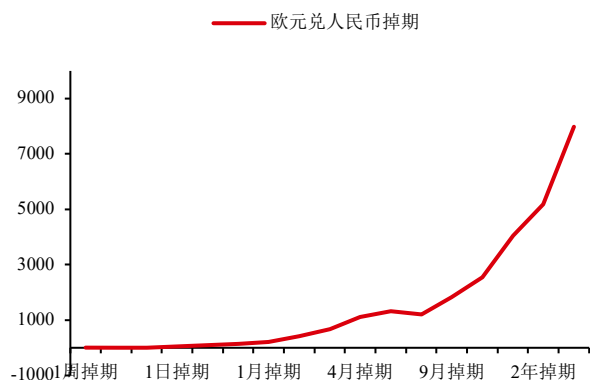
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 28: 美元兑人民币 1 月掉期 单位: 无



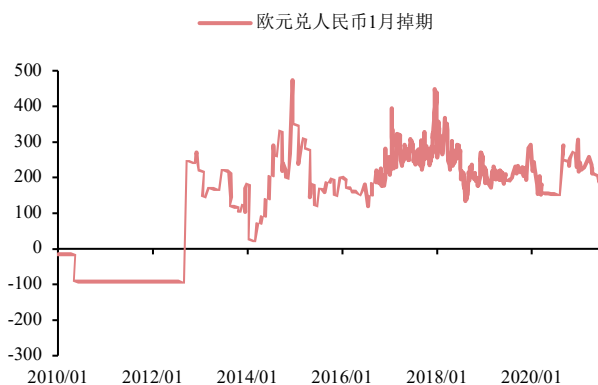
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 29: 欧元兑人民币掉期-不同期限 单位: 无



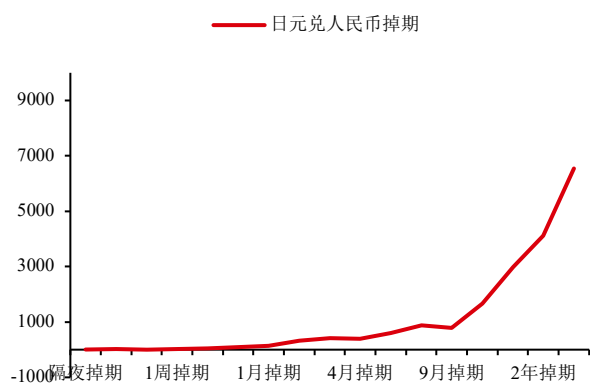
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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



数据来源: Wind 华泰期货研究院

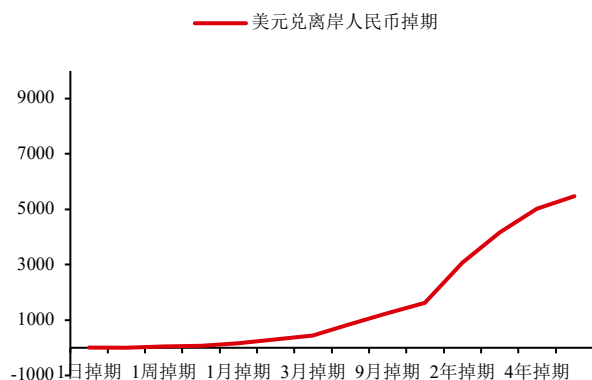
图 32: 日元兑人民币 1 月掉期 单位: 无



数据来源: Wind 华泰期货研究院

## 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



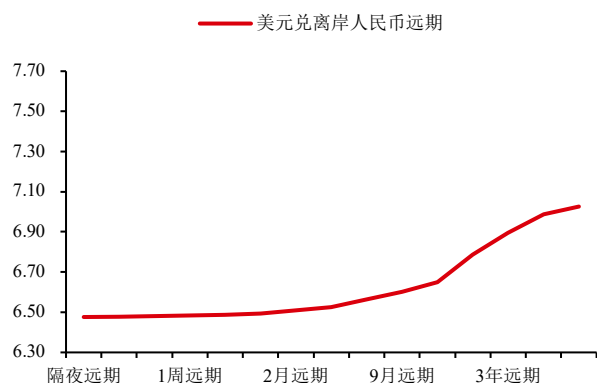
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 34: 美元兑离岸人民币 1 月远期 单位: 无



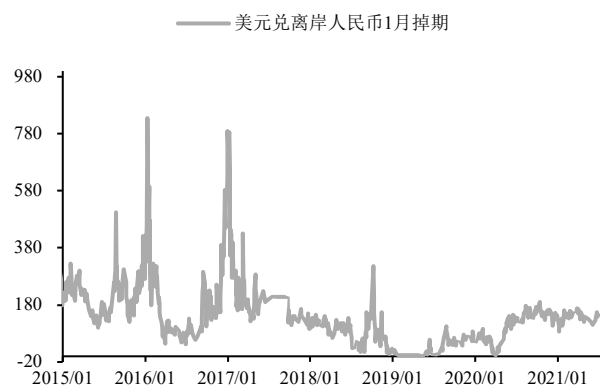
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

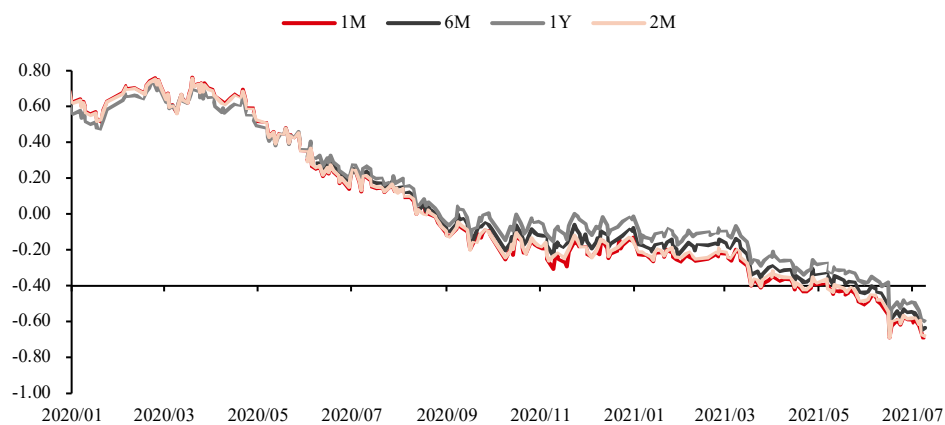


数据来源: Wind 华泰期货研究院

## 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

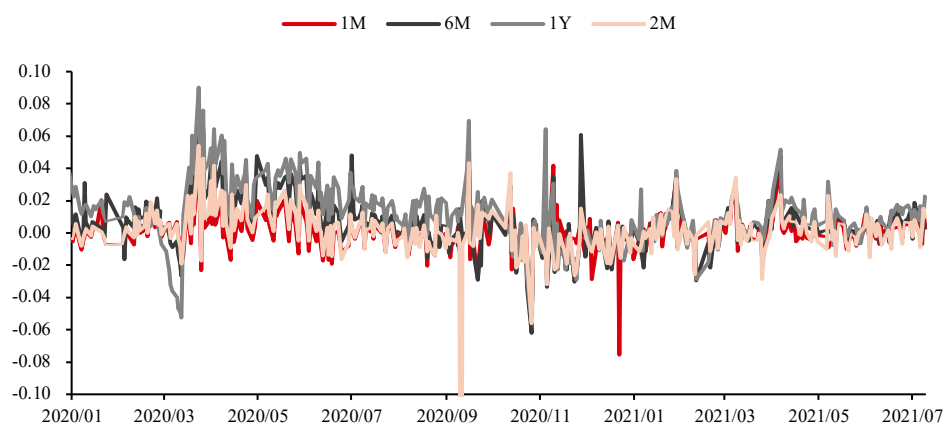
单位: 无



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

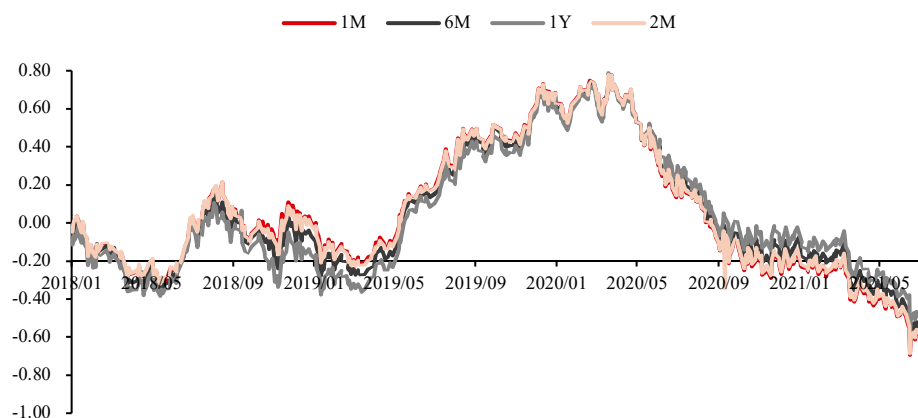
单位: 无



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

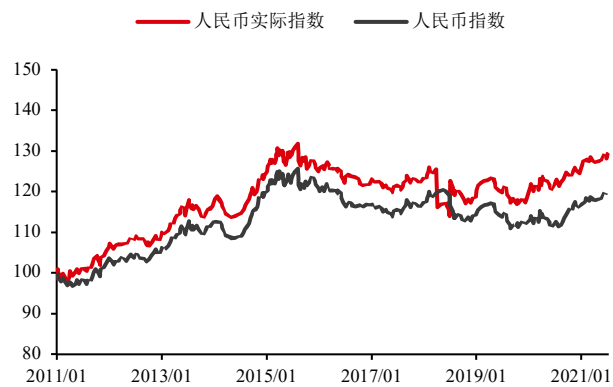


数据来源: Wind 华泰期货研究院

## 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

## 数字货币

图 41: 比特币活跃合约期货价格 单位: 美元/个



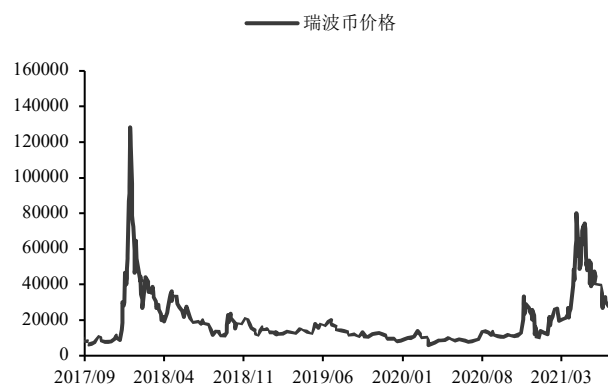
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图 42: 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 43: 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

本研究报告内容既不代表华泰(香港)期货有限公司(“华泰香港期货”)的推荐意见, 也并不构成所涉及的期货及期权产品的买卖或交易之要约。华泰香港期货的销售员, 交易员和其它人员可能会向华泰香港期货的客户提供与本研究部中的观点截然相反的口头或书面市场评论或交易策略。

本报告中的资料力求准确可靠, 但华泰香港期货并不对该等数据的准确性和完整性作出任何承诺。报告中可能存在的一些基于对未来政治和经济的某些主观假定和判断而做出预见性述, 因此可能具有不确定性。投资者应明白及理解投资期货及期权产品之目的, 及当中的风险。在决定投资前, 如有需要, 投资者务必向其专业人士咨询并谨慎抉择。华泰香港期货对任何因信赖或参考报告中内容所导致的损失, 概不负责。

华泰香港期货(或其任何关连或附属公司)、其董事、分析员或其它人员可能持有或买卖所述的投资产品或有关的衍生金融工具等。此外, 华泰香港期货及上述人士均随时可能向报告内容所述及的公司提供投资、顾问或其他服务,

本报告不适用于根据任何管辖地区的相关法律或规例不允许发布或出版本报告的地方, 本报告并没有意图向该等管辖地区的市民或居民或身处于当地的人士或实体发布或供其使用。

本报告由华泰(香港)期货有限公司发布(香港证券及期货事务监察委员会监管之持牌法团, CE 编号: BHE003)。未经华泰香港期货书面同意, 任何人不得以任何目的复制本报告。

## 联系我们





地址:香港上环干诺道 168-200 号信德中心招商局大厦 9 楼 19 室

销售咨询

个人客户:+852 39161688

机构客户:+852 39161633 邮箱:sales@htfc.com.hk 机构客户开户咨询

24 小时客户服务及交易服务

香港专线:+852 39161616

内地专线:+86 400-628-0888(接通后按 8 再按 1) 邮箱:dealing@htfc.com.hk