



研究院 FICC 组

研究员

蔡劭立

☎ 0755-23887993

✉ caishaoli@htfc.com

从业资格号: F3056198

投资咨询号: Z0015616

高聪

☎ 021-60828524

✉ gaocong@htfc.com

从业资格号: F3063338

投资咨询号: Z0016648

孙玉龙

☎ 0755-23887993

✉ sunyulong@htfc.com

从业资格号: F3083038

投资咨询号: Z0016257

投资咨询业务资格:

证监许可【2011】1289号

表 1: 重要外汇期货合约周度变动 | 单位: 无

重要外汇期货合约走势	2023-02-10	2023-02-03	周变动
CME 欧元兑美元	1.0696	1.0819	-1.14%
HKEX 美元兑人民币期货	6.7956	6.7345	0.91%
CME 墨西哥比索兑美元	0.0533	0.0524	1.72%
CME 澳元兑美元	0.6926	0.6931	-0.07%
CME 加元兑美元	0.7498	0.7465	0.44%
CME 英镑兑美元	1.2066	1.2062	0.03%
CME 巴西雷亚尔兑美元	0.1913	0.194	-1.39%
CME 欧元兑美元	1.0696	1.0819	-1.14%
CME 新西兰元兑美元	0.631	0.6325	-0.24%
ICE 美元指数期货	103.47	103.498	-0.03%

数据来源: Wind 华泰期货研究院

表 2: 美元周度变动 | 单位: 无

美元汇率变动	2023-02-10	2023-02-03	周变动
美元指数	103.5757	102.9959	0.56%
欧元兑美元	1.0677	1.0795	-1.09%
美元兑日元	131.3995	131.1805	0.17%
英镑兑美元	1.206	1.205	0.08%
美元兑加元	1.3338	1.3402	-0.48%
澳元兑美元	0.6913	0.6922	-0.13%
新西兰元兑美元	0.6303	0.6347	-0.69%
美元兑瑞郎	0.9238	0.9262	-0.26%
美元兑港币	7.8487	7.8464	0.03%
美元兑新台币	30.127	29.985	0.47%

数据来源: Wind 华泰期货研究院

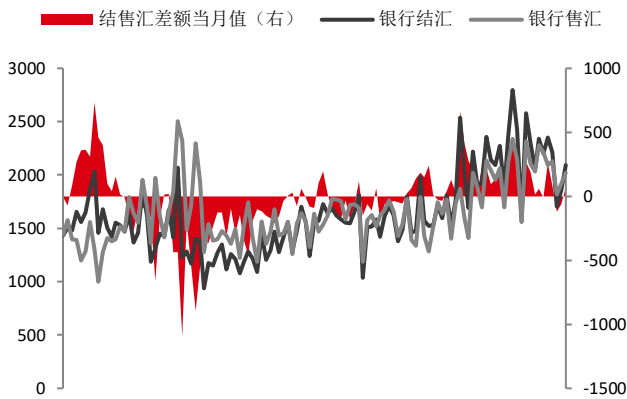
图表

图 1:	银行结售汇情况 单位: 亿美元	4
图 2:	银行结售汇情况 单位: 亿人民币	4
图 3:	香港美元人民币期货活跃合约 单位: 无	4
图 4:	美元指数期货活跃合约 单位: 点	4
图 5:	CME 加元兑美元活跃合约 单位: 无	4
图 6:	CME 英镑兑美元 单位: 无	4
图 7:	CME 瑞郎兑美元 单位: 无	5
图 8:	CME 巴西雷亚尔兑美元 单位: 无	5
图 9:	CME 卢布兑美元 单位: 无	5
图 10:	CME 新西兰元兑美元 单位: 无	5
图 11:	美元指数 单位: 无	5
图 12:	欧元兑美元 单位: 无	5
图 13:	美元兑日元 单位: 无	6
图 14:	英镑兑美元 单位: 无	6
图 15:	美元兑加元 单位: 无	6
图 16:	澳元兑美元 单位: 无	6
图 17:	美元指数期货总持仓 单位: 张	6
图 18:	美元指数期货投机多头情况 单位: 张	6
图 19:	美元中间价 单位: 无	7
图 20:	欧元中间价 单位: 无	7
图 21:	日元中间价 单位: 无	7
图 22:	英镑中间价 单位: 无	7
图 23:	欧元兑人民币远期 单位: 无	8
图 24:	欧元兑人民币一月远期 单位: 无	8
图 25:	美元兑人民币远期 单位: 无	8
图 26:	美元兑人民币一月远期 单位: 无	8
图 27:	日元兑人民币远期 单位: 无	8
图 28:	日元兑人民币一月远期 单位: 无	8
图 29:	美元兑人民币掉期 单位: 无	9
图 30:	美元兑人民币一月掉期 单位: 无	9
图 31:	欧元兑人民币掉期 单位: 无	9
图 32:	欧元兑人民币一月掉期 单位: 无	9
图 33:	日元兑人民币掉期 单位: 无	10
图 34:	日元兑人民币一月掉期 单位: 无	10
图 35:	美元兑人民币远期与美元兑离岸人民币远期价差 单位: 无	10
图 36:	人民币无本金交割远期和美元兑人民币远期价差 单位: 无	11
图 37:	人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差	11
图 38:	外汇指数 单位: 无	12

图 39: 比特币连续合约价格 | 单位: 美元/枚 12

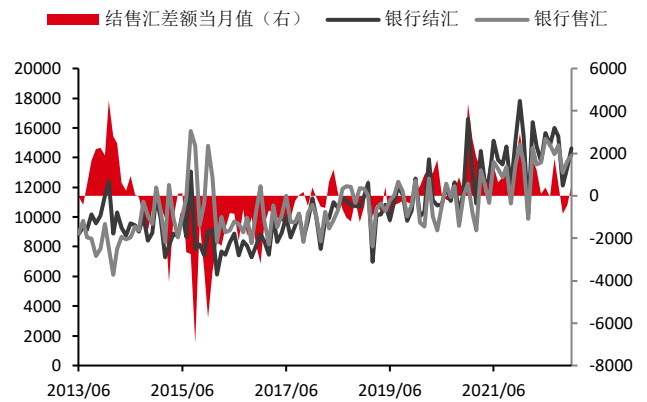
银行结售汇情况

图1: 银行结售汇情况 | 单位: 亿美元



数据来源: Bloomberg 华泰期货研究院

图2: 银行结售汇情况 | 单位: 亿人民币



数据来源: Bloomberg 华泰期货研究院

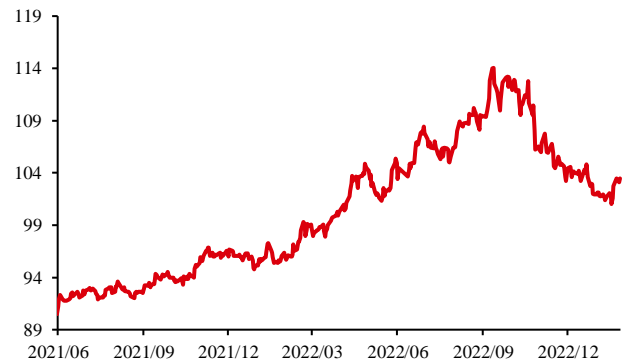
外汇期货活跃合约

图3: 香港美元人民币期货活跃合约 | 单位: 无



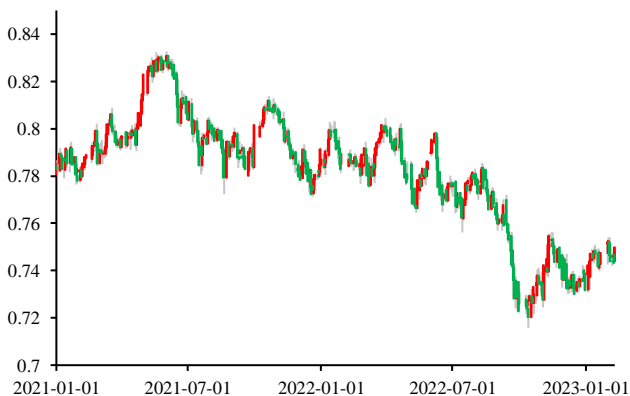
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图4: 美元指数期货活跃合约 | 单位: 点



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图5: CME 加元兑美元活跃合约 | 单位: 无



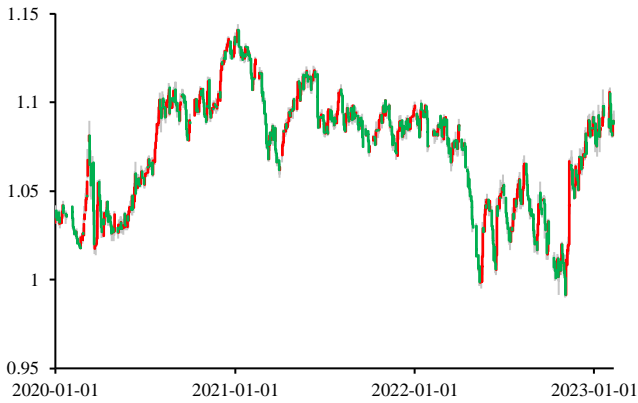
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图6: CME 英镑兑美元 | 单位: 无



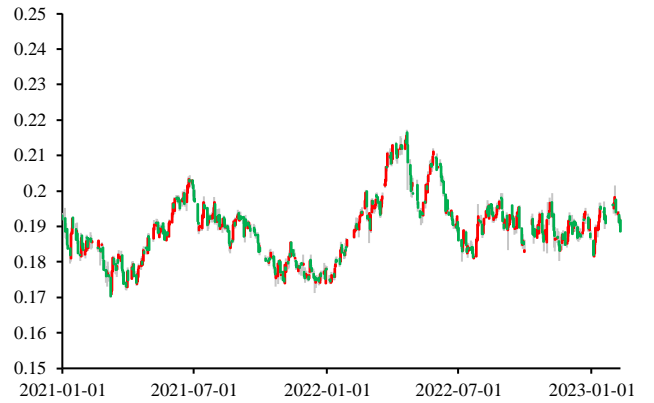
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图7: CME 瑞郎兑美元 | 单位: 无



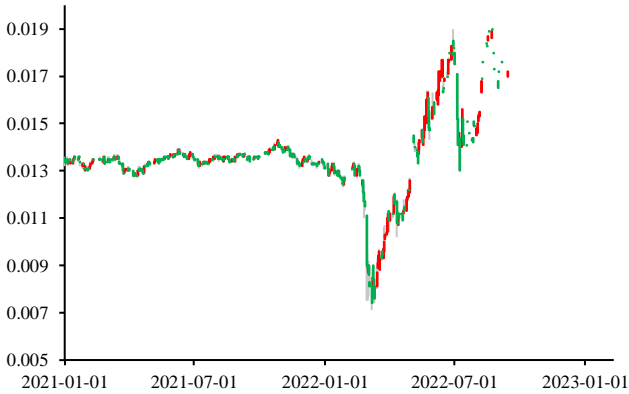
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图8: CME 巴西雷亚尔兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图9: CME 卢布兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图10: CME 新西兰元兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg 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: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图12: 欧元兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图13: 美元兑日元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图14: 英镑兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图15: 美元兑加元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

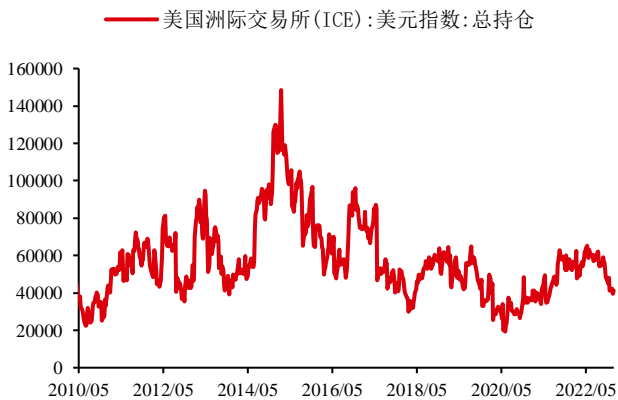
图16: 澳元兑美元 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

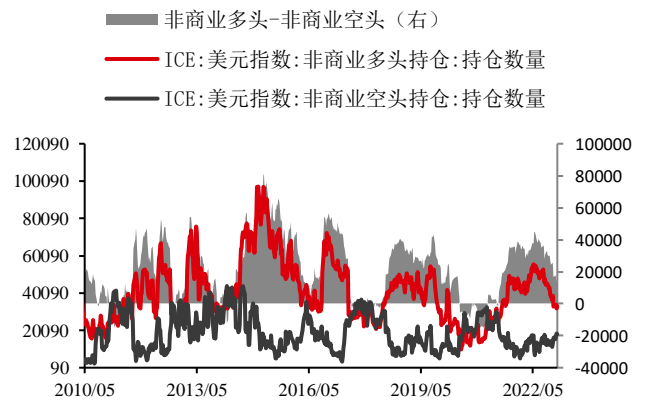
美元指数期货 CFTC 持仓

图17: 美元指数期货总持仓 | 单位: 张



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图18: 美元指数期货投机多头情况 | 单位: 张



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

人民币中间价

图19: 美元中间价 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图20: 欧元中间价 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图21: 日元中间价 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

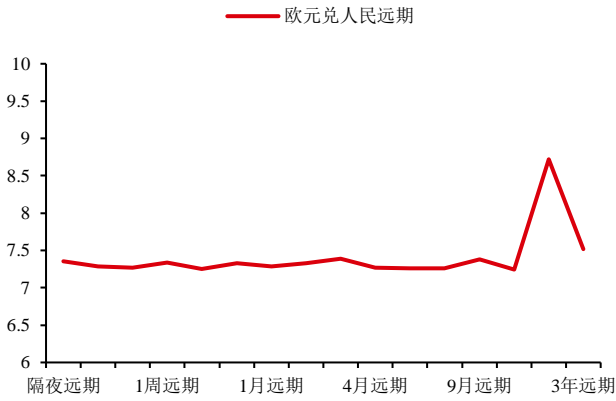
图22: 英镑中间价 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

人民币远期

图23: 欧元兑人民币远期 | 单位: 无



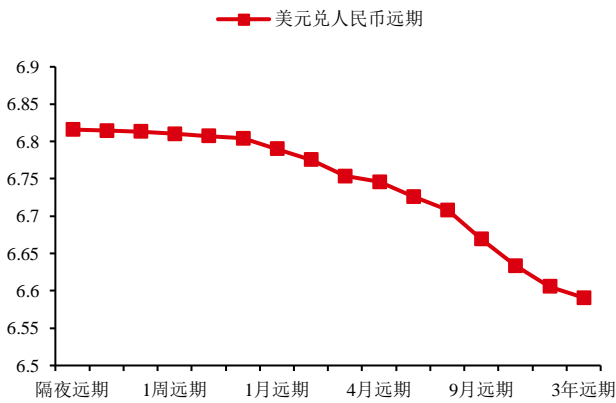
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图24: 欧元兑人民币一月远期 | 单位: 无



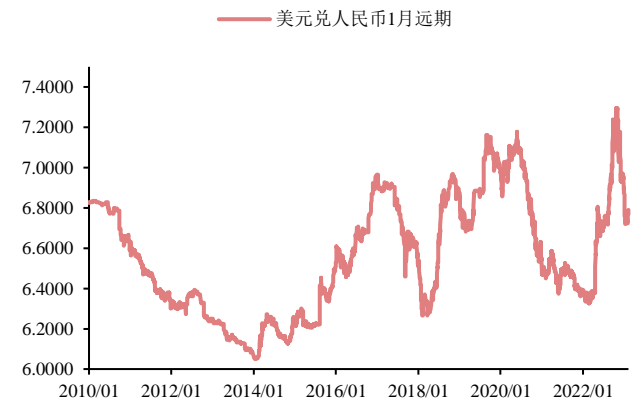
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图25: 美元兑人民币远期 | 单位: 无



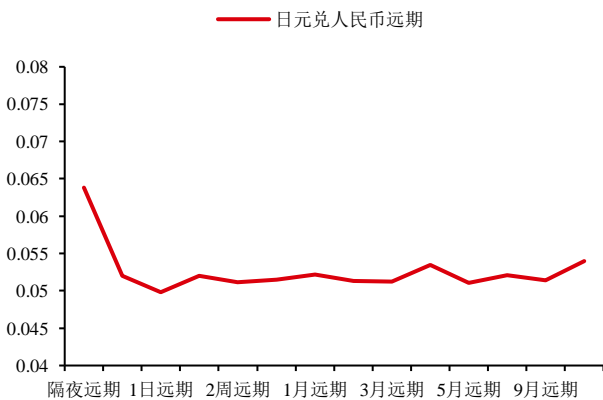
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图26: 美元兑人民币一月远期 | 单位: 无



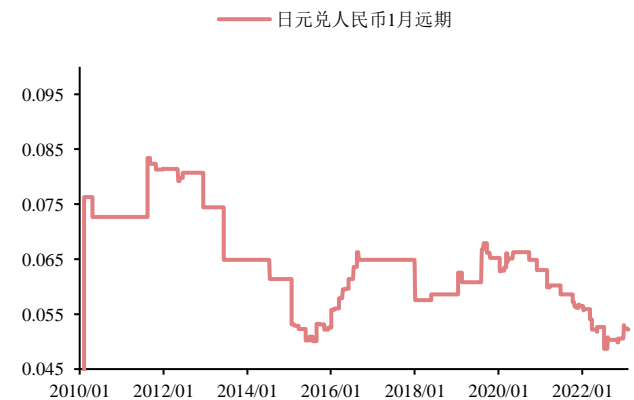
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图27: 日元兑人民币远期 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

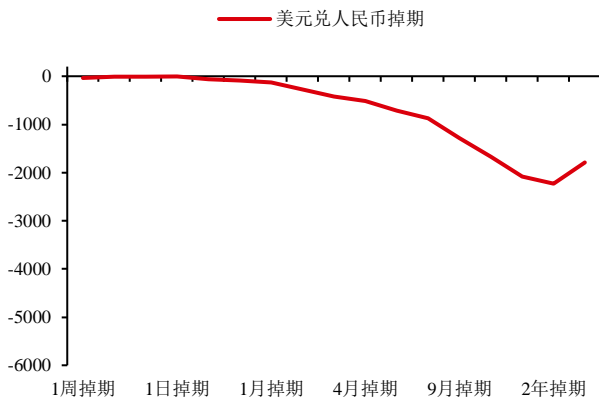
图28: 日元兑人民币一月远期 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

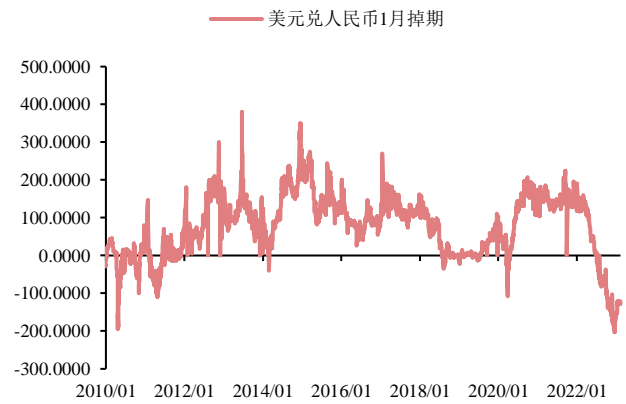
人民币掉期

图29: 美元兑人民币掉期 | 单位: 无



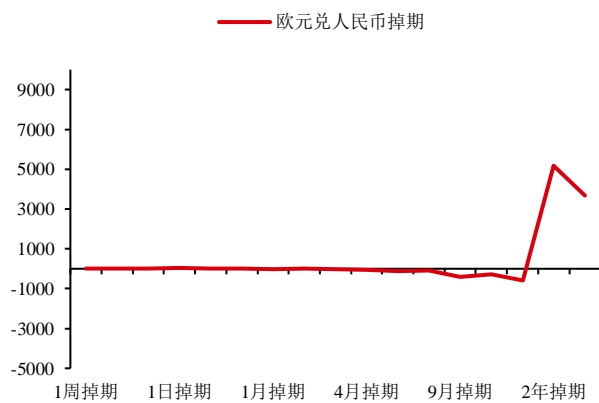
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图30: 美元兑人民币一月掉期 | 单位: 无



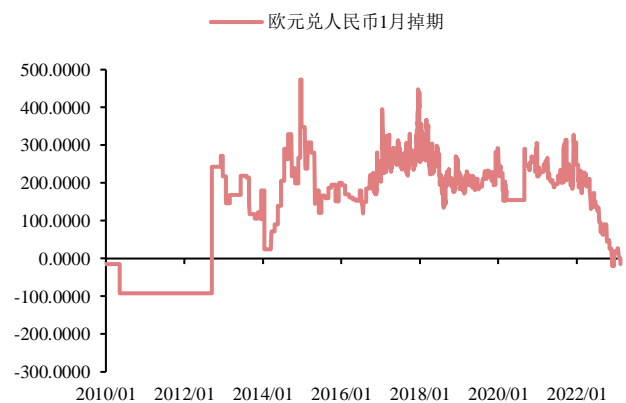
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图31: 欧元兑人民币掉期 | 单位: 无



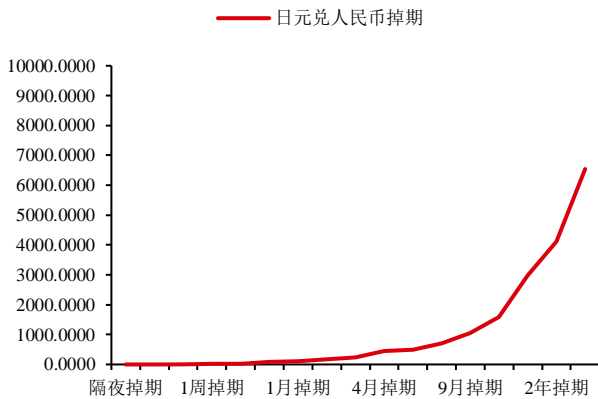
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图32: 欧元兑人民币一月掉期 | 单位: 无



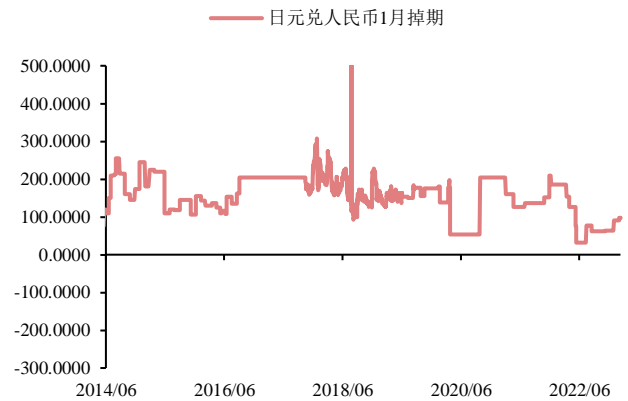
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图33: 日元兑人民币掉期 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

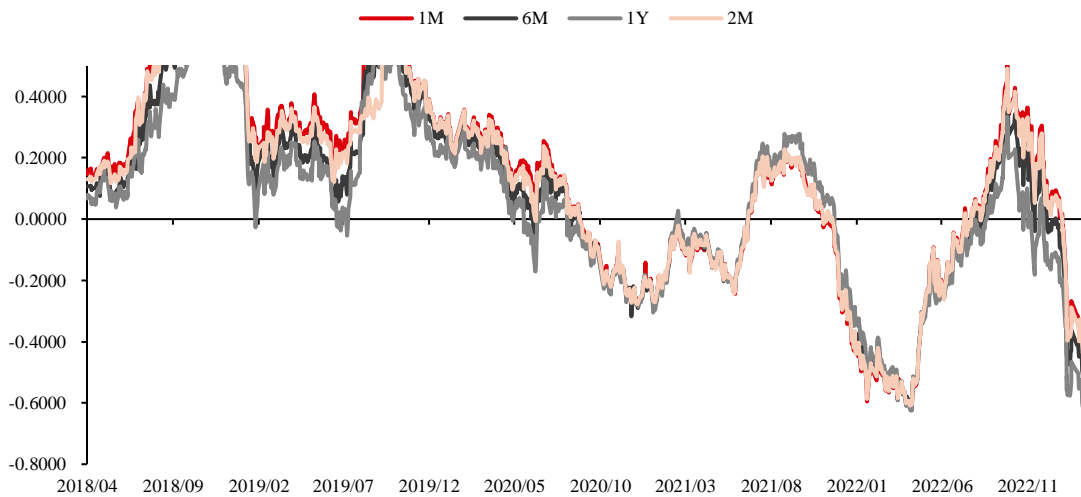
图34: 日元兑人民币一月掉期 | 单位: 无



数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

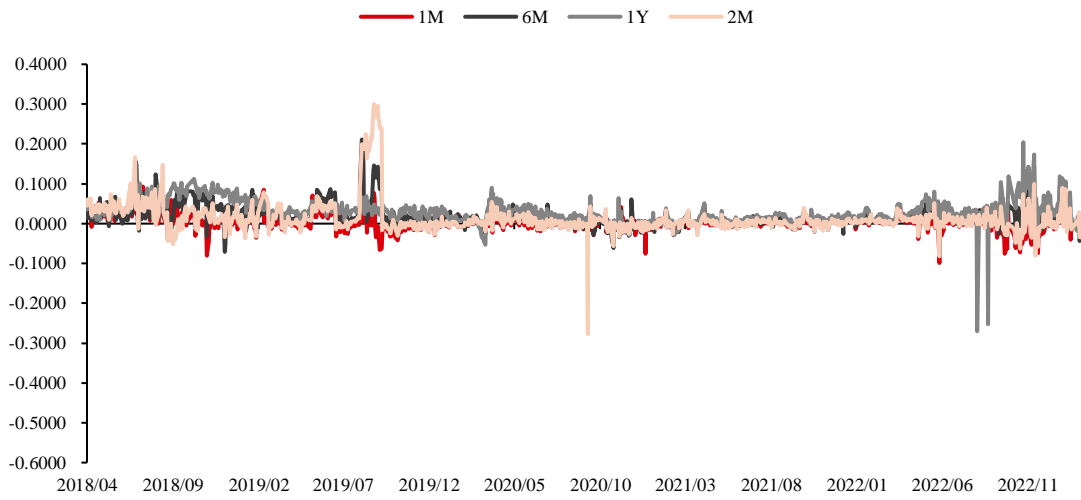
外汇价差

图35: 美元兑人民币远期与美元兑离岸人民币远期价差 | 单位: 无



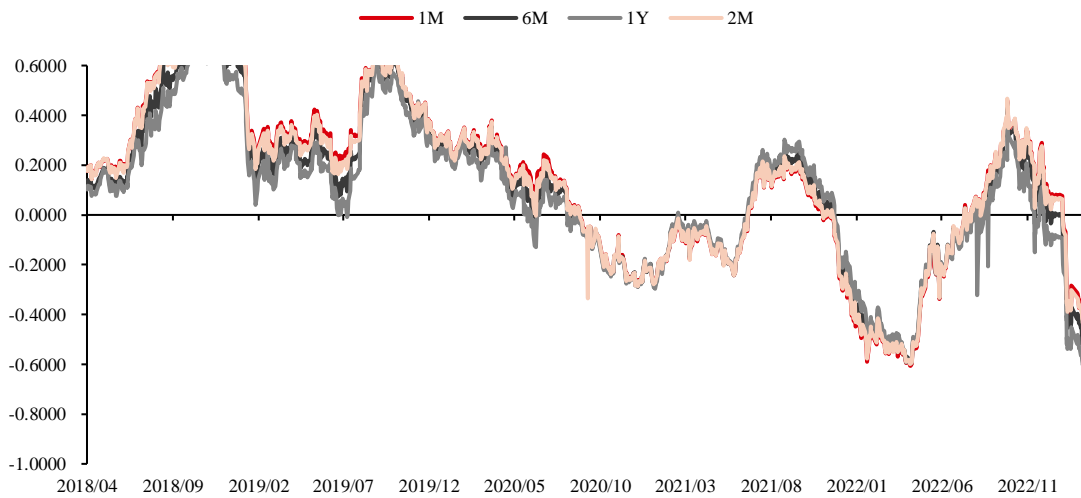
数据来源: Bloomberg Wind 华泰期货研究院

图36： 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：Bloomberg Wind 华泰期货研究院

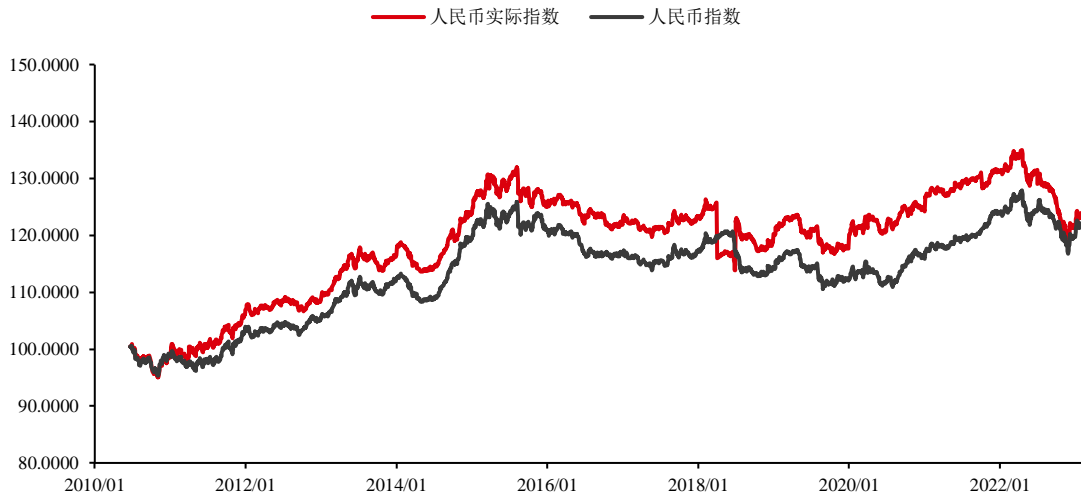
图37： 人民币无本金交割远期和美元兑离岸人民币远期价差



数据来源：Bloomberg Wind 华泰期货研究院

外汇指数

图38： 外汇指数 | 单位：无



数据来源：Bloomberg Wind 华泰期货研究院

数字货币

图39： 比特币连续合约价格 | 单位：美元/枚



数据来源：Bloomberg 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

广州市天河区临江大道1号之一2101-2106单元 | 邮编：510000

电话：400-6280-888

网址：www.htfc.com