

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-04-24】

今天人民币兑美元中间价报 7.1048，较上一交易日下降 11 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.7，2w 成交 1.6/1.8，1m 成交 2.365/2.43/2.45，6m 成交 4.1，1y 成交 4.76。

BF 方面 (25d)，2w 成交 0.345，3w 成交 0.3475，2m 成交 0.315，3m 成交 0.3。

RR 方面 (25d)，2m 成交 0.425，3m 成交 0.425，6m 成交 0.45/0.5，1y 成交 0.675。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
04/24/2024	7.1048	-11
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.0	1.7	
2w 1.0 / 3.0	1.6/1.8	
1s 2.0 / 5.0	2.365/2.43/2.45	
2s 2.0 / 5.0		
3s 3.0 / 5.0		
6s 3.0 / 5.0	4.1	
9s 4.0 / 5.5		
1y 4.0 / 5.5	4.76	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.5		
2s 0/0.6	0.425	
3s 0.2/0.8	0.425	
6s 0.2/0.8	0.45/0.5	
9s 0.4/0.8		
1y 0.6/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4	0.315	
3s 0.3 / 0.4	0.31	
6s 0.3 / 0.4		
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 0.4		

Daisy Dai

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所提及的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN