

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-10】

今天人民币兑美元中间价报 7.1011，较上一交易日下降 17 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0，1m 成交 2.15，3m 成交 3.25/3.275，6m 成交 4.325/4.35，9m 成交 4.6，1y 成交 4.675。

BF 方面（25d），6m 成交 0.315，1y 成交 0.32。

RR 方面（25d），2m 成交 0.025，3m 成交 0.175。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/10/2024	7.1011	-17
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.5	2.0	
2w 1.0 / 3.5		
1s 2.0 / 4.0	2.15	
2s 2.0 / 4.0		
3s 3.0 / 5.0	3.25/3.275	
6s 3.0 / 5.0	4.325/4.35	
9s 4.0 / 5.5	4.6	
1y 4.0 / 5.5	4.675	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.1/0.2		
2s -0.1/0.3	0.025	
3s 0.1/0.4	0.175	
6s 0.2/0.5		
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4		
3s 0.3 / 0.4		
6s 0.3 / 0.4	0.315	
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 0.4	0.32	

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:

以上所登及附加的所有信息（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