

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

 **NEX** 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-02-02】

今天人民币兑美元中间价报 7.1006，较上一交易日上调 43 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 2.925，6m 成交 4.395，1y 成交 4.58/4.59

FLY 方面（25d），1m/2m 成交 0.22，1y 成交 0.27

RR 方面（25d），1m 成交-0.2

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/02/2024		7.1006	-43
ATM		Traded	Changes
1w	3.0 / 5.0		
2w	3.0 / 5.0	2.925	
1s	3.5 / 5.0		
2s	3.5 / 5.0	5	
3s	3.5 / 5.0		
6s	4.0 / 5.5	4.395	
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.58/4.59	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3	-0.2	
2s	-0.5 / 0.3		
3s	-0.5/ 0.3		
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7		
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3	0.22	
2s	0.2 / 0.3	0.22	
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4		
9s	0.25 / 0.4		
1y	0.25 / 0.4	0.27	

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：

以上所含及附加的所有信息（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

