

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

【2024-10-09】

今天人民币兑美元中间价报 7.0568，较上一交易日调升 141 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.5，2w 成交 5.15/5.2，1m 成交 6.8，2m 成交 5.975，3m 成交 5.825/5.84， 6m 成交 5.225/5.25/5.275，9m 成交 5.175，1y 成交 5.1/5.115/5.125。

BF 方面（10d），1y 成交 0.8。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
10/09/2024		7.0568	141
ATM		Traded	Changes
1w	4.0/6.0	5.5	
2w	4.0/6.0	5.15/5.2	
1s	4.0/5.5	6.8	
2s	5.0/6.0	5.975	
3s	5.0/6.0	5.825/5.84	
6s	4.5/5.5	5.225/5.25/5.275	
9s	4.5/5.5	5.175	
1y	4.5/5.5	5.1/5.115/5.125	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.3/0.5		
2s	-0.3/0.5		
3s	0/0.5		
6s	0.2/0.6		
9s	0.3/0.8		
1y	0.4/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2/0.5		
1s	0.25/0.35		
2s	0.25/0.35		
3s	0.25/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		

Bill Tang

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