

常规报告系列



收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-05-23】

今天人民币兑美元中间价报 7.1098，较上一交易日上升 21 个基点。

期权 ATM 方面， 1m 成交 2.4/2.425/2.45， 2m 成交 2.75/2.775， 3m 成交 3.175/3.2/3.25， 1y 成交 4.675。

BF 方面（25d）， 1m 成交 0.29， 1y 成交 0.3。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.15， 3m 成交 0.125， 6m 成交 0.4125， 1y 成交 0.575。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
05/23/2024		7.1098	21
ATM		Traded	Changes
1w	1.5 /3.5		
2w	1.5 / 3.5		
1s	2.0 /4.0	2.4/2.425/2.45	
2s	2.0 / 4.0	2.75/2.775	
3s	3.0 / 5.0	3.175/3.2/3.25	
6s	3.0 / 5.0		
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.675	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5/0	-0.15	
2s	-0.2/0		
3s	0/0.2	0.125	
6s	0.2/0.5	0.4125	
9s	0.4/0.8		
1y	0.5/0.8	0.575	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.25 / 0.35		
1s	0.25 / 0.35	0.29	
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	0.3	

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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息