



【2024-07-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.1313，较上一交易日下降 2 个基点。

期权 ATM 方面， 2w 成交 2.0/2.025/2.05， 1m 成交 2.25， 3m 成交 3.1， 1y 成交 4.65。

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.2225， 6m 成交 0.245， 1y 成交 0.26。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.35， 2m 成交-0.275， 3m 成交-0.15。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	07/15/2024	
	7.1313	-2
	ATM	Traded
	Changes	
1w	1.0/3.0	
2w	1.0/3.0	2.0/2.025/2.05
1s	1.0 /3.0	2.25
2s	2.0 / 4.0	
3s	2.0 / 4.0	3.1
6s	3.0 / 5.0	
9s	4.0 / 5.5	
1y	4.0 / 5.5	4.65
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.4/0	-0.35
2s	-0.4/0	-0.275
3s	-0.3/0	-0.15
6s	0.2/0.5	
9s	0.4/0.8	
1y	0.5/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.2 / 0.3	
1s	0.2 / 0.3	
2s	0.2 / 0.3	0.2225
3s	0.2 / 0.3	
6s	0.2 / 0.3	0.245
9s	0.2 / 0.3	
1y	0.2 / 0.3	0.26

Daisy Dai

联系人: Rafoel Wang
邮箱: rafoel.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