

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2024-05-31】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1088，较上一交易日下降 23 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.875，1m 成交 2.4，2m 成交 2.8/2.9，3m 成交 3.15/3.25，6m 成交 4.325，9m 成交 4.5/4.51，1y 成交 4.6。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.28。

RR 方面 (25d)，1w 成交-0.5，2w 成交-0.45/-0.4。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
05/31/2024		7.1088	23
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/3.0	1.875	
2w	1.0/3.0		
1s	2.0 / 4.0	2.4	
2s	2.0 / 4.0	2.8/2.9	
3s	3.0 / 5.0	3.15/3.25	
6s	3.0 / 5.0	4.325	
9s	4.0 / 5.5	4.5/4.51	
1y	4.0 / 5.5	4.6	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.2/0		
2s	-0.2/0.1		
3s	0/0.2		
6s	0.2/0.5		
9s	0.4/0.8		
1y	0.5/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.25 / 0.35		
1s	0.25 / 0.35	0.28	
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		

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:**

以上所提及的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)