



【2024-07-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.1339，较上一交易日下降 3 个基点。

期权 ATM 方面， 1m 成交 2.05，2m 成交 2.525/2.55，3m 成交 3.1，6m 成交 4.3/4.31/4.325，9m 成交 4.545，1y 成交 4.63/4.64/4.65。

BF 方面（25d）， 3m 成交 0.2525，9m 成交 0.27，1y 成交 0.2675/0.27/0.2725。

RR 方面（25d）， 1w 成交-0.4，1m 成交-0.3，6m 成交 0.365/0.375/0.4，6m 成交 0.4。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	07/11/2024	
	ATM	Traded
Changes		
1w	1.0/3.0	
2w	1.0/3.0	
1s	1.0 / 3.0	2.05
2s	2.0 / 4.0	2.525/2.55
3s	2.0 / 4.0	3.1
6s	3.0 / 5.0	4.3/4.31/4.325
9s	4.0 / 5.5	4.545
1y	4.0 / 5.5	4.63/4.64/4.65
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		
	Traded	changes
1s	-0.4/0	-0.3
2s	-0.2/0	
3s	0/0.3	
6s	0.2/0.5	0.365/0.375/0.4
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	
3s	0.2 / 0.3	0.2525
6s	0.2 / 0.3	
9s	0.2 / 0.3	0.27
1y	0.2 / 0.3	0.2675/0.27/0.2725

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