

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-08-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1299，较上一交易日上升 83 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.4/4.7，2w 成交 5.1，2m 成交 4.75/4.8，3m 成交 5.0/5.075/5.1，6m 成交 4.975/5.0，1y 成交 4.925/4.95/4.975/5.0。

RR 方面（25d），1m 成交-0.975/-0.925/-0.85/-0.8，2m 成交-0.7/-0.65/-0.6，3m 成交-0.3，6m 成交 0.025/0.05/0.075。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
08/29/2024		7.1299
		83
ATM		Traded
		Changes
1w	1.0/6.0	4.4/4.7
2w	1.0/6.0	5.1
1s	2.0 / 6.0	
2s	2.0 / 6.0	4.75/4.8
3s	2.0 / 6.0	5.0/5.075/5.1
6s	3.0 / 6.0	4.975/5.0
9s	4.0 / 5.5	
1y	4.0 / 5.5	4.925/4.95/4.975/5.0
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-1.5/0	-0.975/-0.925/-0.85/-0.8
2s	-1.0/0	-0.7/-0.65/-0.6
3s	-1.0/0	-0.3
6s	-0.1/0.2	0.025/0.05/0.075
9s	0.2/0.5	
1y	0.3/0.6	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.1 / 0.4	
1s	0.1 / 0.4	
2s	0.1 / 0.4	
3s	0.1 / 0.4	
6s	0.2 / 0.4	
9s	0.2 / 0.4	
1y	0.2 / 0.4	

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