

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-07-01】

今天人民币兑美元中间价报 7.1265，较上一交易日下降 3 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.09/2.1，1m 成交 2.4，2m 成交 2.725，6m 成交 4.28，1y 成交 4.625。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.2375，2m 成交 0.24，6m 成交 0.27，9m 成交 0.275，1y 成交 0.2775。

RR 方面 (25d)，1m 成交 -0.05/-0.15/-0.25，3m 成交 0.1，6m 成交 0.45。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
07/01/2024	7.1265	-3
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/3.0	2.09/2.1	
2w 1.0/3.0		
1s 2.0 /4.0	2.4	
2s 2.0 / 4.0	2.725	
3s 3.0 / 5.0		
6s 3.0 / 5.0	4.28	
9s 4.0 / 5.5		
1y 4.0 / 5.5	4.625	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.4/0	-0.25/-0.15/-0.05	
2s 0/0.2		
3s 0/0.3	0.1	
6s 0.2/0.5	0.45	
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.2 / 0.3	0.2375	
2s 0.2 / 0.3	0.24	
3s 0.25 / 0.35		
6s 0.25 / 0.35	0.27	
9s 0.25 / 0.35	0.275	
1y 0.25 / 0.35	0.2775	

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