



【2024-06-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.1270，较上一交易日上升 22 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.3/2.4，2w 成交 2.3/2.35，1m 成交 2.4/2.5，2m 成交 2.775，6m 成交 4.2775/4.2825，9m 成交 4.525，1y 成交 4.625。

BF 方面（25d），2m 成交 0.2425，6m 成交 0.2725，9m 成交 0.2775。

RR 方面（25d），1m 成交-0.1，1y 成交 0.6625。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
06/27/2024		22
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/3.0	2.3/2.4	
2w 1.0/3.0	2.3/2.35	
1s 2.0 /4.0	2.4/2.5	
2s 2.0 / 4.0	2.775	
3s 3.0 / 5.0		
6s 3.0 / 5.0	4.2775/4.2825	
9s 4.0 / 5.5	4.525	
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	-0.1	
2s 0/0.2		
3s 0/0.3		
6s 0.2/0.5		
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8	0.6625	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.2 / 0.3		
2s 0.2 / 0.3	0.2425	
3s 0.25 / 0.35		
6s 0.25 / 0.35	0.2725	
9s 0.25 / 0.35	0.2775	
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