

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-09-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.0101，较上一交易日调升 253 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 5.8，3m 成交 5.4， 6m 成交 5.1/5.11，1y 成交 4.975/5.075。

RR 方面（25d），2w 成交-1.0，3m 成交-0.1625。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
09/27/2024		7.0101
		253
ATM		Traded
		Changes
1w	4.0/6.0	
2w	4.0/6.0	5.8
1s	4.0/5.5	
2s	5.0/6.0	
3s	5.0/6.0	5.4
6s	4.5/5.5	5.1/5.11
9s	4.5/5.5	
1y	4.5/5.5	4.975/5.075
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-1.0/0	
2s	-0.3/0	
3s	-0.2/0	-0.1625
6s	0.1/0.3	
9s	0.3/0.5	
1y	0.4/0.6	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.1/0.4	
1s	0.25/0.35	
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	

Bill Tang

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