

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-09-19】

今天人民币兑美元中间价报 7.0983，较上一交易日调贬 113 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.0/4.1/4.2/4.3/4.4/4.5/4.75/4.8，2w 成交 4.0，1m 成交 4.45/4.5，3m 成交 4.85，6m 成交 4.825/4.85，9m 成交 4.825，1y 成交 4.835/4.85。

RR 方面 (25d)，3m 成交-0.025。

BF 方面 (25d)，2w 成交 0.3，1m 成交 0.285，6m 成交 0.28，9m 成交 0.28，1y 成交 0.28。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
09/19/2024	7.0983	113
ATM	Traded	Changes
1w 4.0/6.0	4.0/4.1/4.2/4.3/4.4/4.5/4.75/4.8	
2w 4.0/6.0	4.0	
1s 3.0/5.0	4.45/4.5	
2s 4.5/5.5		
3s 4.5/5.5	4.85	
6s 4.5/5.5	4.825/4.85	
9s 4.5/5.5	4.825	
1y 4.5/5.5	4.835/4.85	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -1.0/0		
2s -0.2/0		
3s -0.1/0.1	-0.025	
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	0.285	
2s 0.25/0.35		
3s 0.25/0.35		
6s 0.25/0.35	0.28	
9s 0.25/0.35	0.28	
1y 0.25/0.35	0.28	

Bill Tang

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:

以上所念及附加的所有信息 (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