

常规报告系列

收盘日评

银行间外汇期权市场

【2024-05-09】

今天人民币兑美元中间价报 7.1028，较上一交易日上升 12 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0，1m 成交 2.1/2.175/2.2/2.3/2.4，2m 成交 2.7，3m 成交 3.3/3.325/3.35，6m 成交 4.35/4.4，1y 成交 4.725。

BF 方面（25d），1m 成交 0.32，1y 成交 0.32。

RR 方面（25d），1m 成交-0.05，2m 成交 0.05，3m 成交 0.175，6m 成交 0.35。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	05/09/2024	7.1028
	ATM	Traded
		Changes
1w	1.0 /3.5	2.0
2w	1.0 / 3.5	
1s	2.0 /4.0	2.1/2.175/2.2/2.3/2.4
2s	2.0 / 4.0	2.7
3s	3.0 / 5.0	3.3/3.325/3.35
6s	3.0 / 5.0	4.35/4.4
9s	4.0 / 5.5	
1y	4.0 / 5.5	4.725
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.1/0.2	-0.05
2s	-0.1/0.3	0.05
3s	0.1/0.4	0.175
6s	0.2/0.5	0.35
9s	0.4/0.8	
1y	0.5/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.3 / 0.4	
1s	0.3 / 0.4	0.32
2s	0.3 / 0.4	
3s	0.3 / 0.4	
6s	0.3 / 0.4	
9s	0.3 / 0.4	
1y	0.3 / 0.4	0.32

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