

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.1049，较上一交易日下降 4 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.7/3.2，1m 成交 2.6/2.65/2.7/2.8/2.85/2.9，2m 成交 3.0，3m 成交 3.3375/3.375，6m 成交 4.3875/4.4，9m 成交 4.6，1y 成交 4.7125/4.725。

BF 方面 (25d)，6m 成交 0.315。

RR 方面 (25d)，1m 成交 -0.4，2m 成交 -0.05/-0.025/0，3m 成交 0.1，6m 成交 0.35，9m 成交 0.475，1y 成交 0.55。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/15/2024	7.1049	4
ATM	Traded	Changes
1w 2.0 / 3.5	2.7/3.2	
2w 2.0 / 3.5		
1s 2.0 / 4.0	2.6/2.65/2.7/2.8/2.85/2.9	
2s 2.0 / 4.0	3.0	
3s 3.0 / 5.0	3.3375/3.375	
6s 3.0 / 5.0	4.3875/4.4	
9s 4.0 / 5.5	4.6	
1y 4.0 / 5.5	4.7125/4.725	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.5/0	-0.4	
2s -0.2/0	-0.05/-0.025/0	
3s 0/0.2	0.1	
6s 0.2/0.5	0.35	
9s 0.4/0.8	0.475	
1y 0.5/0.8	0.55	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4		
3s 0.3 / 0.4		
6s 0.3 / 0.4	0.315	
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 0.4		

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:**

以上所提及的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)