

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-21】

今天人民币兑美元中间价报 7.1069，较上一交易日上升 27 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0/2.05/2.15，1m 成交 2.35，2m 成交 2.7/2.75，6m 成交 4.35/4.375/4.4，9m 成交 4.575/4.6，1y 成交 4.675/4.7。

BF 方面 (25d)，1w 成交 0.3275，3w 成交 0.3，1m 成交 0.285/0.29/0.2925/0.295，2m 成交 0.285/0.2925/0.295。

RR 方面 (25d)，1w 成交-0.6，1m 成交-0.2/-0.25，6m 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/21/2024	7.1069	27
ATM	Traded	Changes
1w 1.5 / 3.5	2.0/2.05/2.15	
2w 1.5 / 3.5		
1s 2.0 / 4.0	2.35	
2s 2.0 / 4.0	2.7/2.75	
3s 3.0 / 5.0		
6s 3.0 / 5.0	4.35/4.375/4.4	
9s 4.0 / 5.5	4.575/4.6	
1y 4.0 / 5.5	4.675/4.7	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.5/0	-0.25/-0.2	
2s -0.2/0		
3s 0/0.2		
6s 0.2/0.5	0.3	
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.25 / 0.35	0.3275	
1s 0.25 / 0.35	0.285/0.29/0.2925/0.295	
2s 0.25 / 0.35	0.285/0.2925/0.295	
3s 0.25 / 0.35		
6s 0.25 / 0.35		
9s 0.25 / 0.35		
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:

以上所登及附加的所有信息 (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