

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-07-26】

今天人民币兑美元中间价报 7.1270，较上一交易日下降 51 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 3.24/3.3/3.4/3.5，2m 成交 3.5，3m 成交 3.49/3.65/3.75，9m 成交 4.6，1y 成交 4.75。

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.65。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
07/26/2024	7.1270	51
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/3.0		
2w 1.0/3.0		
1s 2.0 /4.0	3.24/3.3/3.4/3.5	
2s 2.0 / 4.0	3.5	
3s 2.0 / 4.0	3.49/3.65/3.75	
6s 3.0 / 5.0		
9s 4.0 / 5.5	4.6	
1y 4.0 / 5.5	4.75	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.8/0	-0.65	
2s -0.6/0		
3s -0.4/0		
6s 0.2/0.5		
9s 0.3/0.6		
1y 0.4/0.7		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.1 / 0.3		
1s 0.1 / 0.3		
2s 0.1 / 0.3		
3s 0.1 / 0.3		
6s 0.2 / 0.3		
9s 0.2 / 0.3		
1y 0.2 / 0.3		

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