



【2024-08-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.1399，较上一交易日下降 16 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.3，2w 成交 4.3，1m 成交 4.265/4.27/4.325/4.35，2m 成交 4.35/4.4/4.45，3m 成交 4.7/4.75/4.775，9m 成交 4.775。

RR 方面（25d），1w 成交-1.5，2m 成交-0.875/-0.9，3m 成交-0.5。

BF 方面（25d），1m 成交 0.2825，3m 成交 0.285。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
08/15/2024		7.1399	-16
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/6.0	4.3	
2w	1.0/6.0	4.3	
1s	2.0 /6.0	4.265/427/4.325/4.35	
2s	2.0 / 6.0	4.35/4.4/4.45	
3s	2.0 / 6.0	4.7/4.75/4.775	
6s	3.0 / 6.0		
9s	4.0 / 5.5	4.775	
1y	4.0 / 5.5		
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-1.5/0		
2s	-1.0/0	-0.875/-0.9	
3s	-1.0/0	-0.5	
6s	0/0.3		
9s	0.3/0.6		
1y	0.4/0.7		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.1 / 0.4		
1s	0.1 / 0.4	0.2825	
2s	0.1 / 0.4		
3s	0.1 / 0.4	0.285	
6s	0.2 / 0.4		
9s	0.2 / 0.4		
1y	0.2 / 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