

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-04-10】

今天人民币兑美元中间价报 7.0959，较上一交易日上升 3 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 1.8，3w 成交 2.2，2m 成交 3.05/3.125，3m 成交 3.5，6m 成交 4.075/4.085，8m 成交 4.575/4.585/4.6，9m 成交 4.625/4.635/4.65，1y 成交 4.725/4.75。

RR 方面 (25d)，1m 成交 0.05，2m 成交 0.1。

BF 方面 (25d)，2m 成交 0.355，2m 成交 0.305。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
04/10/2024	7.0959	3
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.0		
2w 1.0 / 3.0	1.8	
1s 2.0 / 5.0		
2s 2.0 / 5.0	3.05/3.125	
3s 3.0 / 5.0	3.5	
6s 3.0 / 5.0	4.075/4.085	
9s 4.0 / 5.5	4.625/4.635/4.65	
1y 4.0 / 5.5	4.725/4.75	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.4	0.05	
2s 0 / 0.4	0.1	
3s 0.2 / 0.6		
6s 0.2 / 0.8		
9s 0.4 / 0.8		
1y 0.6 / 0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4	0.305	
3s 0.3 / 0.4	0.305	
6s 0.3 / 0.4		
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 0.4		

Daisy Dai

联系人: Rafoel Wang
邮箱: rafoel.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:

以上所发及附加的所有信息 (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