

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-02-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.1068，较上一交易日下调 36 个基点。

期权 ATM 方面， 2w 成交 1.95/2.05/2.1， 1m 成交 2.85， 3m 成交 3.8， 1y 成交 4.6

FLY 方面（25d）， 1y 成交 0.265

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.2， 9m 成交 0.45/0.475

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/20/2024		7.1068	36
ATM		Traded	Changes
1w	2.0 / 5.0		
2w	2.0 / 5.0	1.95/2.05/2.1	
1s	3.5 / 5.0	2.85	
2s	3.5 / 5.0		
3s	3.5 / 5.0	3.8	
6s	4.0 / 5.5		
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.6	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3	-0.2	
2s	-0.5 / 0.3		
3s	-0.5/ 0.3		
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7	0.45/0.475	
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4		
9s	0.25 / 0.4		
1y	0.25 / 0.4	0.265	

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