

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-11-04】

今天人民币兑美元中间价报 7.1203，较上一交易日调贬 68 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 6.9/6.925/6.95，3m 成交 5.5/5.525，6m 成交 5.2/5.225/5.23，9m 成交 5.15，1y 成交 5.1。

RR 方面（25d），1m 成交-0.05/-0.1，2m 成交-0.025/0.025，3m 成交 0.15。

BF 方面（25d），1w 成交 0.175。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/04/2024		68
ATM	Traded	Changes
1w	5.0/10.0	
2w	6.0/10.0	
1s	5.0/8.0	6.9/6.925/6.95
2s	5.0/7.0	
3s	5.0/7.0	5.5/5.525
6s	4.5/5.5	5.2/5.225/5.23
9s	4.5/5.5	5.15
1y	4.5/5.5	5.1
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	0/0.3	-0.1/-0.05
2s	0/0.3	-0.025/0.025
3s	0/0.4	0.15
6s	0.2/0.5	
9s	0.3/0.5	
1y	0.4/0.6	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.1/0.3	0.175
1s	0.20/0.30	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	

Bill Tang

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