

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-02-22】

今天人民币兑美元中间价报 7.1018，较上一交易日上调 12 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.1，2w 成交 2.3，2m 成交 3.475，6m 成交 4.2/4.2125，1y 成交 4.55/4.57

FLY 方面 (25d)，2m 成交 0.225，1y 成交 0.265/0.27

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.425，9m 成交 0.5

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/22/2024		7.1018	12
ATM		Traded	Changes
1w	2.0 / 5.0	2.1	
2w	2.0 / 5.0	2.3	
1s	3.5 / 5.0		
2s	3.5 / 5.0	3.475	
3s	3.5 / 5.0		
6s	4.0 / 5.5	4.2/4.2125	
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.55/4.57	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3	-0.45/-0.425	
2s	-0.5 / 0.3		
3s	-0.5 / 0.3		
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7	0.5	
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3	0.225	
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4		
9s	0.25 / 0.4		
1y	0.25 / 0.4	0.265/0.27	

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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)