

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-08】

今天人民币兑美元中间价报 7.1016，较上一交易日上升 14 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 2.5，2m 成交 2.9，3m 成交 3.4，6m 成交 4.4/4.425，9m 成交 4.65，1y 成交 4.725/4.75。

RR 方面 (25d)，2w/3w 成交-0.25，1m 成交-0.05/0，2m 成交 0.1，3m 成交 0.2，1y 成交 0.5125/0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/08/2024	7.1016	14
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.5		
2w 1.0 / 3.5		
1s 2.0 / 5.0	2.5	
2s 2.0 / 5.0	2.9	
3s 3.0 / 5.0	3.4	
6s 3.0 / 5.0	4.4/4.425	
9s 4.0 / 5.5	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 -0.1/0.2	-0.05/0	
2s -0.1/0.3	0.1	
3s 0.1/0.5	0.2	
6s 0.2/0.8		
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8	0.5125/0.525	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4		
3s 0.3 / 0.4		
6s 0.3 / 0.4		
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 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:**

以上所提及的所有信息 (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)