



【2024-05-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.1042，较上一交易日下降 3 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0/2.1/2.11/2.2/2.25/2.4，2w 成交 2.0/2.2/2.29/2.3，1m 成交 2.3/2.305/2.35/2.4/2.42/2.44/2.45，2m 成交 2.65/2.67/2.695/2.7/2.75，3m 成交 3.15/3.195/3.2，6m 成交 4.3/4.35/4.4，9m 成交 4.5/4.55/4.58，1y 成交 4.65/4.675/4.7。

BF 方面（25d），1m 成交 0.2975/0.3，2m 成交 0.295/0.3，3m 成交 0.305。

RR 方面（25d），1m 成交-0.2。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	05/20/2024	7.1042
	ATM	-3
		Traded
		Changes
1w	1.5 /3.5	2.0/2.1/2.11/2.2/2.25/2.4
2w	1.5 / 3.5	2.0/2.2/2.29/2.3
1s	2.0 /4.0	2.3/2.305/2.35/2.4/2.45/2.44/2.45
2s	2.0 / 4.0	2.65/2.67/2.695/2.7/2.75
3s	3.0 / 5.0	3.15/3.195/3.2
6s	3.0 / 5.0	4.3/4.35/4.4
9s	4.0 / 5.5	4.5/4.55/4.58
1y	4.0 / 5.5	4.65/4.675/4.7
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.5/0	-0.2
2s	-0.2/0	
3s	0/0.2	
6s	0.2/0.5	
9s	0.4/0.8	
1y	0.5/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.3 / 0.4	
1s	0.3 / 0.4	0.2975/0.3
2s	0.3 / 0.4	0.295/0.3
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：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