

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-02-07】

今天人民币兑美元中间价报 7.1049，较上一交易日下调 33 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 3.05/3.1，1m 成交 3.4， 9m 成交 4.565

FLY 方面（25d），1y 成交 0.27

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
02/07/2024		7.1049
		-33
ATM		Traded
		Changes
1w	3.0 / 5.0	
2w	3.0 / 5.0	3.05/3.1
1s	3.5 / 5.0	3.4
2s	3.5 / 5.0	
3s	3.5 / 5.0	
6s	4.0 / 5.5	
9s	4.0 / 5.5	4.565
1y	4.0 / 5.5	
2y	4.5 / 5.5	
3y	4.5 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.5 / 0.3	
2s	-0.5 / 0.3	
3s	-0.5/ 0.3	
6s	0.2 / 0.6	
9s	0.3 / 0.7	
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	0.27

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