



【2024-08-19】

今天人民币兑美元中间价报 7.1415，较上一交易日下降 49 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.6/4.8，1m 成交 4.6/4.75/4.85，3m 成交 4.75/4.85/4.925/4.97，6m 成交 4.825/4.875/4.9/4.95，1y 成交 4.875/4.975。

RR 方面（25d），6m 成交 0.025。

BF 方面（25d），1w 成交 0.3，1m 成交 0.2875。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |           |                      |         |
|---------------------------|-----------|----------------------|---------|
| 08/19/2024                |           | 7.1415               | 49      |
| ATM                       |           | Traded               | Changes |
| 1w                        | 1.0/6.0   | 4.6/4.8              |         |
| 2w                        | 1.0/6.0   |                      |         |
| 1s                        | 2.0 /6.0  | 4.6/4.75/4.85        |         |
| 2s                        | 2.0 / 6.0 |                      |         |
| 3s                        | 2.0 / 6.0 | 4.75/4.85/4.925/4.97 |         |
| 6s                        | 3.0 / 6.0 | 4.825/4.875/4.9/4.95 |         |
| 9s                        | 4.0 / 5.5 |                      |         |
| 1y                        | 4.0 / 5.5 | 4.875/4.975          |         |
| 2y                        | 4.0 / 5.5 |                      |         |
| 3y                        | 4.0 / 5.5 |                      |         |
| 25d RR                    |           | Traded               | changes |
| 1s                        | -1.5/0    |                      |         |
| 2s                        | -1.0/0    |                      |         |
| 3s                        | -1.0/0    |                      |         |
| 6s                        | 0/0.3     | 0.025                |         |
| 9s                        | 0.3/0.6   |                      |         |
| 1y                        | 0.4/0.7   |                      |         |
| 25d FLY                   |           | Traded               | changes |
| 1w                        | 0.1 / 0.4 | 0.3                  |         |
| 1s                        | 0.1 / 0.4 | 0.2875               |         |
| 2s                        | 0.1 / 0.4 |                      |         |
| 3s                        | 0.1 / 0.4 |                      |         |
| 6s                        | 0.2 / 0.4 |                      |         |
| 9s                        | 0.2 / 0.4 |                      |         |
| 1y                        | 0.2 / 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