

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.1045，较上一交易日上升 25 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.2/2.225/2.25/2.3，1y 成交 4.635。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.3025，1y 成交 0.315。

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.3，6m 成交 0.325/0.35，1y 成交 0.55。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP | | | |
|---------------------------|-----------|--------------------|---------|
| 05/17/2024 | | 7.1045 | 25 |
| ATM | | Traded | Changes |
| 1w | 2.0 / 3.5 | 2.2/2.225/2.25/2.3 | |
| 2w | 2.0 / 3.5 | | |
| 1s | 2.0 / 4.0 | | |
| 2s | 2.0 / 4.0 | | |
| 3s | 3.0 / 5.0 | | |
| 6s | 3.0 / 5.0 | | |
| 9s | 4.0 / 5.5 | | |
| 1y | 4.0 / 5.5 | 4.635 | |
| 2y | 4.0 / 5.5 | | |
| 3y | 4.0 / 5.5 | | |
| 25d RR | | Traded | changes |
| 1s | -0.5/0 | -0.3 | |
| 2s | -0.2/0 | | |
| 3s | 0/0.2 | | |
| 6s | 0.2/0.5 | 0.325/0.35 | |
| 9s | 0.4/0.8 | | |
| 1y | 0.5/0.8 | 0.55 | |
| 25d FLY | | Traded | changes |
| 1w | 0.3 / 0.4 | | |
| 1s | 0.3 / 0.4 | 0.3025 | |
| 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 | 0.315 | |

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