

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

【2024-05-16】

今天人民币兑美元中间价报 7.1020，较上一交易日下降 29 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.3，2w 成交 2.1，1m 成交 2.45/2.7，2m 成交 2.7/2.8，3m 成交 3.2。

BF 方面（25d），1m 成交 0.31，6m 成交 0.31，9m 成交 0.31，1y 成交 0.315/0.32。

RR 方面（25d），3m 成交 0.075，1y 成交 0.55。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/16/2024		29
ATM		Traded
		Changes
1w	2.0 /3.5	2.3
2w	2.0 / 3.5	2.1
1s	2.0 /4.0	2.45/2.7
2s	2.0 / 4.0	
3s	3.0 / 5.0	3.2
6s	3.0 / 5.0	
9s	4.0 / 5.5	
1y	4.0 / 5.5	
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.5/0	
2s	-0.2/0	
3s	0/0.2	0.075
6s	0.2/0.5	
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	0.31
2s	0.3 / 0.4	
3s	0.3 / 0.4	
6s	0.3 / 0.4	0.31
9s	0.3 / 0.4	0.31
1y	0.3 / 0.4	0.315/0.32

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