

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-10-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.1220，较上一交易日调贬 29 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.5，2w 成交 4.65/4.7，3w 成交 6.5/6.6，1m 成交 6.6/6.7，2m 成交 6.2/6.25/6.275/6.3，9m 成交 5.325，1y 成交 5.185/5.2125。

RR 方面 (25d)，2m 成交 0.1875。

BF 方面 (25d)，6m 成交 0.29，9m 成交 0.2875/0.29，1y 成交 0.29。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
10/17/2024	7.1220	29
ATM	Traded	Changes
1w 4.0/6.0	4.5	
2w 4.0/6.0	4.65/4.7	
1s 5.0/7.0	6.6/6.7	
2s 5.0/7.0	6.2/6.25/6.275/6.3	
3s 5.0/6.0		
6s 4.5/5.5		
9s 4.5/5.5	5.325	
1y 4.5/5.5	5.185/5.2125	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.3/0.5		
2s -0.3/0.5	0.1875	
3s 0/0.5		
6s 0.2/0.6		
9s 0.3/0.8		
1y 0.4/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2/0.5		
1s 0.25/0.35		
2s 0.25/0.35		
3s 0.25/0.35		
6s 0.25/0.35	0.29	
9s 0.25/0.35	0.2875/0.29	
1y 0.25/0.35	0.29	

Bill Tang

联系人: Rafoel Wang
邮箱: rafoel.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:

以上所念及附加的所有信息 (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