

常规报告系列

收盘日评

银行间外汇期权市场

【2024-06-5】

今天人民币兑美元中间价报 7.1097，较上一交易日上调 14 个基点。

期权 ATM 方面，3w 成交 2.5/2.55,1m 成交 2.5/2.575,2m 成交 2.875，3m 成交 3.25， 9m 成交 4.5

BF 方面（25d）， 1m 成交 0.27/0.2725,3m 成交 0.28， 6m/9m 成交 0.29

RR 方面（25d）， 2w 成交-0.575

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
06/5/2024		7.1097	14
ATM		Traded	Changes
1w	1.5 /3.5		
2w	1.5 / 3.5		
1s	2.0 /4.0	2.5/2.575	
2s	2.0 / 4.0	2.875	
3s	3.0 / 5.0	3.225	
6s	3.0 / 5.0		
9s	4.0 / 5.5	4.5	
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		
6s	0.2/0.5		
9s	0.4/0.8		
1y	0.5/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.3 / 0.4		
1s	0.3 / 0.4	0.27/0.2725	
2s	0.3 / 0.4		
3s	0.3 / 0.4	0.28	
6s	0.3 / 0.4	0.29	
9s	0.3 / 0.4	0.29	
1y	0.3 / 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