



【2024-06-20】

今天人民币对美元中间价报 7.1192，较上一交易日上升 33 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.1，2w 成交 2.15/2.2，2m 成交 2.6/2.605，3m 成交 3.0/3.1，9m 成交 4.5/4.505，1y 成交 4.6/4.625。

BF 方面（25d），2m 成交 0.2475，6m 成交 0.2775，9m 成交 0.28，1y 成交 0.2825。

RR 方面（25d），1w 成交-0.1，2m 成交 0/0.05/0.1，3m 成交 0.1/0.15/0.2。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
06/20/2024		7.1192
		33
ATM		Traded
		Changes
1w	1.0/3.0	2.1
2w	1.0/3.0	2.15/2.2
1s	2.0 /4.0	
2s	2.0 / 4.0	2.6/2.605
3s	3.0 / 5.0	3.0/3.1
6s	3.0 / 5.0	
9s	4.0 / 5.5	4.5/4.505
1y	4.0 / 5.5	4.6/4.625
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.4/0	
2s	0/0.2	0/0.05/0.1
3s	0/0.3	0.1/0.15/0.2
6s	0.2/0.5	
9s	0.4/0.8	
1y	0.5/0.8	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.2 / 0.3	
1s	0.2 / 0.3	
2s	0.2 / 0.3	0.2475
3s	0.25 / 0.35	
6s	0.25 / 0.35	0.2775
9s	0.25 / 0.35	0.28
1y	0.25 / 0.35	0.2825

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