

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2024-07-16】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1328，较上一交易日上升 15 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 1.95，1m 成交 2.175/2.2，2m 成交 2.6，1y 成交 4.66。

BF 方面 (25d)，3m 成交 0.233，9m 成交 0.2575，1y 成交 0.26。

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.375/-0.35，6m 成交-0.3，1y 成交 0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
07/16/2024	7.1328	15
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/3.0		
2w 1.0/3.0	1.95	
1s 1.0 /3.0	2.175/2.2	
2s 2.0 / 4.0	2.6	
3s 2.0 / 4.0		
6s 3.0 / 5.0		
9s 4.0 / 5.5		
1y 4.0 / 5.5	4.66	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.4/0	-0.375/-0.35	
2s -0.4/0		
3s -0.3/0		
6s 0.2/0.5	0.3	
9s 0.3/0.6		
1y 0.4/0.7	0.525	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.2 / 0.3		
2s 0.2 / 0.3		
3s 0.2 / 0.3	0.233	
6s 0.2 / 0.3		
9s 0.2 / 0.3	0.2575	
1y 0.2 / 0.3	0.26	

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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)