



【2024-08-06】

今天人民币兑美元中间价报 7.1318，较上一交易日下降 27 个基点。

期权 ATM 方面， 1w 成交 5.5， 2w 成交 5.5， 1m 成交 4.8/4.9/4.975/5.0， 2m 成交 4.55/4.575/4.6/4.65/4.9， 3m 成交 4.75/4.8/4.85/4.9/5.0/5.1， 6m 成交 4.725/4.75/4.775/4.8， 9m 成交 4.825/4.85， 1y 成交 4.9/4.95/5.0。

RR 方面（25d）， 1m 成交-1.3/-1.2/-1.1。

BF 方面（25d）， 1y 成交 0.3

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
08/06/2024		7.1318	27
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/10.0	5.5	
2w	1.0/10.0	5.5	
1s	2.0 /6.0	4.8/4.9/4.975/5.0	
2s	2.0 / 6.0	4.55/4.575/4.6/4.65/4.9	
3s	2.0 / 6.0	4.75/4.8/4.85/4.9/5.0/5.1	
6s	3.0 / 6.0	4.725/4.75/4.775/4.8	
9s	4.0 / 5.5	4.825/4.85	
1y	4.0 / 5.5	4.9/4.95/5.0	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-1.5/0	-1.3/-1.2/-1.1	
2s	-1.0/0		
3s	-1.0/0		
6s	0/0.3		
9s	0.3/0.6		
1y	0.4/0.7		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.1 / 0.4		
1s	0.1 / 0.4		
2s	0.1 / 0.4		
3s	0.1 / 0.4		
6s	0.2 / 0.4		
9s	0.2 / 0.4		
1y	0.2 / 0.4	0.3	

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