

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-07-02】

今天人民币兑美元中间价报 7.1291，较上一交易日上升 26 个基点。

期权 ATM 方面，6m 成交 4.315，9m 成交 4.525/4.5875，1y 成交 4.65/4.675/4.6875。

BF 方面 (25d)，2m 成交 0.24，6m 成交 0.27，9m 成交 0.2725/0.275。

RR 方面 (25d)，9m 成交 0.55/0.56，1y 成交 0.65。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |                   |         |
|---------------------------|-------------------|---------|
| 07/02/2024                | 7.1291            | 26      |
| ATM                       | Traded            | Changes |
| 1w 1.0/3.0                |                   |         |
| 2w 1.0/3.0                |                   |         |
| 1s 2.0 /4.0               |                   |         |
| 2s 2.0 / 4.0              |                   |         |
| 3s 3.0 / 5.0              |                   |         |
| 6s 3.0 / 5.0              | 4.315             |         |
| 9s 4.0 / 5.5              | 4.525/4.5875      |         |
| 1y 4.0 / 5.5              | 4.65/4.675/4.6875 |         |
| 2y 4.0 / 5.5              |                   |         |
| 3y 4.0 / 5.5              |                   |         |
| 25d RR                    | Traded            | changes |
| 1s -0.4/0                 |                   |         |
| 2s 0/0.2                  |                   |         |
| 3s 0/0.3                  |                   |         |
| 6s 0.2/0.5                |                   |         |
| 9s 0.4/0.8                | 0.55/0.56         |         |
| 1y 0.5/0.8                | 0.65              |         |
| 25d FLY                   | Traded            | changes |
| 1w 0.2 / 0.3              |                   |         |
| 1s 0.2 / 0.3              |                   |         |
| 2s 0.2 / 0.3              | 0.24              |         |
| 3s 0.25 / 0.35            |                   |         |
| 6s 0.25 / 0.35            | 0.27              |         |
| 9s 0.25 / 0.35            | 0.2725/0.275      |         |
| 1y 0.25 / 0.35            |                   |         |

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)