

常规报告系列

收盘日评

银行间外汇期权市场

【2024-02-08】

今天人民币兑美元中间价报 7.1063，较上一交易日上调 14 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 3.0， 1y 成交 4.6

RR 方面（25d），1M 成交-0.3，9m 成交 0.475

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/08/2024		7.1063	14
ATM		Traded	Changes
1w	3.0 / 5.0		
2w	3.0 / 5.0	3.0	
1s	3.5 / 5.0		
2s	3.5 / 5.0		
3s	3.5 / 5.0		
6s	4.0 / 5.5		
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.6	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3	-0.3	
2s	-0.5 / 0.3		
3s	-0.5/ 0.3		
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7	0.475	
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4		
9s	0.25 / 0.4		
1y	0.25 / 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