

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-08-13】

今天人民币兑美元中间价报 7.1479，较上一交易日上升 21 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.4/4.6/5.0，2w 成交 4.2，1m 成交 4.35，2m 成交 4.45/4.475/4.5/4.525，3m 成交 4.65/4.7，6m 成交 4.8/4.85，9m 成交 4.85/4.875，1y 成交 4.9/4.925。

RR 方面 (25d)，1m 成交-1.1，3m 成交-0.35。

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

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
08/13/2024	7.1479	21
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/6.0	4.4/4.6/5.0	
2w 1.0/6.0	4.2	
1s 2.0 /6.0	4.35	
2s 2.0 / 6.0	4.45/4.475/4.5/4.525	
3s 2.0 / 6.0	4.65/4.7	
6s 3.0 / 6.0	4.8/4.85	
9s 4.0 / 5.5	4.85/4.875	
1y 4.0 / 5.5	4.9/4.925	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -1.5/0	-1.1	
2s -1.0/0		
3s -1.0/0	-0.35	
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	0.2775	
9s 0.2 / 0.4	0.28	
1y 0.2 / 0.4	0.28	

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:

以上所登及附加的所有信息 (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