

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-05-06】

今天人民币兑美元中间价报 7.0994，较上一交易日下降 69 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.65/2.7/3.0，3m 成交 3.55/3.6，6m 成交 4.6/4.65/4.7，9m 成交 4.7/4.75，1y 成交 4.825。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.325。

RR 方面 (25d)，1m 成交 0.1，2m 成交 0.1，1y 成交 0.5。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/06/2024	7.0994	69
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.5	2.65/2.7/3.0	
2w 1.0 / 3.5		
1s 2.0 / 5.0		
2s 2.0 / 5.0		
3s 3.0 / 5.0	3.55/3.6	
6s 3.0 / 5.0	4.6/4.65/4.7	
9s 4.0 / 5.5	4.7/4.75	
1y 4.0 / 5.5	4.825	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.5	0.1	
2s 0/0.6	0.1	
3s 0.2/0.8		
6s 0.2/0.8		
9s 0.4/0.8		
1y 0.5/0.8	0.5	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4	0.325	
2s 0.3 / 0.4		
3s 0.3 / 0.4		
6s 0.3 / 0.4		
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)