

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-09-02】

今天人民币兑美元中间价报 7.1027，较上一交易日下降 97 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.0，2w 成交 4.95，1m 成交 4.95，1y 成交 4.975。

RR 方面（25d），3m 成交-0.275/-0.2375，6m 成交 0.1。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
09/02/2024		7.1027
ATM		97
		Traded
		Changes
1w	1.0/6.0	5.0
2w	1.0/6.0	4.95
1s	2.0 /6.0	4.95
2s	2.0 / 6.0	
3s	2.0 / 6.0	
6s	3.0 / 6.0	
9s	4.0 / 5.5	
1y	4.0 / 5.5	4.975
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-1.5/0	
2s	-1.0/0	
3s	-1.0/0	-0.275/-0.2375
6s	-0.1/0.2	0.1
9s	0.2/0.5	
1y	0.3/0.6	
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	

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