【2024-11-01】

今天人民币兑美元中间价报 7.1135，较上一交易日调升 115 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 5.75/5.77，2m 成交 5.9，3m 成交 5.65/5.675/5.7，6m 成交 5.275，9m 成交 5.2，1y 成交 5.15。

RR 方面（25d），1m 成交 0.05。

BF 方面（25d），3m 成交 0.27/0.275，9m 成交 0.28。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	11/01/2024	7.1135	115
	ATM	Traded	Changes
1w	5.0/10.0		
2w	6.0/10.0		
1s	5.0/8.0	5.75/5.77	
2s	5.0/7.0	5.9	
3s	5.0/7.0	5.65/5.675/5.7	
6s	4.5/5.5	5.275	
9s	4.5/5.5	5.2	
1y	4.5/5.5	5.15	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	0/0.3	0.05	
2s	0/0.3		
3s	0/0.4		
6s	0.2/0.5		
9s	0.3/0.5		
1y	0.4/0.6		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.2/0.5		
1s	0.20/0.30		
2s	0.20/0.30		
3s	0.20/0.30	0.27/0.275	
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.28	
1y	0.25/0.35		

Bill Tang

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。