



【2024-10-10】

今天人民币兑美元中间价报 7.0742，较上一交易日调贬 174 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.2/5.4/5.45，1m 成交 6.75，2m 成交 6.0， 6m 成交 5.275/5.3/5.325，9m 成交 5.175， 1y 成交 5.12/5.125。

RR 方面（25d），3m 成交 0.15。

BF 方面（25d），1m 成交 0.325，2m 成交 0.325，6m 成交 0.2875/0.29，9m 成交 0.2875， 1y 成交 0.2875/0.29。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |           |                 |         |
|---------------------------|-----------|-----------------|---------|
| 10/10/2024                |           | 7.0742          | 174     |
| ATM                       |           | Traded          | Changes |
| 1w                        | 4.0/6.0   | 5.2/5.4/5.45    |         |
| 2w                        | 4.0/6.0   |                 |         |
| 1s                        | 4.0/5.5   | 6.75            |         |
| 2s                        | 5.0/6.0   | 6.0             |         |
| 3s                        | 5.0/6.0   |                 |         |
| 6s                        | 4.5/5.5   | 5.275/5.3/5.325 |         |
| 9s                        | 4.5/5.5   | 5.175           |         |
| 1y                        | 4.5/5.5   | 5.12/5.125      |         |
| 2y                        | 4.5/5.5   |                 |         |
| 3y                        | 4.5/5.5   |                 |         |
| 25d RR                    |           | Traded          | changes |
| 1s                        | -0.3/0.5  |                 |         |
| 2s                        | -0.3/0.5  |                 |         |
| 3s                        | 0/0.5     | 0.15            |         |
| 6s                        | 0.2/0.6   |                 |         |
| 9s                        | 0.3/0.8   |                 |         |
| 1y                        | 0.4/0.8   |                 |         |
| 25d FLY                   |           | Traded          | changes |
| 1w                        | 0.2/0.5   |                 |         |
| 1s                        | 0.25/0.35 | 0.325           |         |
| 2s                        | 0.25/0.35 | 0.325           |         |
| 3s                        | 0.25/0.35 |                 |         |
| 6s                        | 0.25/0.35 | 0.2875/0.29     |         |
| 9s                        | 0.25/0.35 | 0.2875          |         |
| 1y                        | 0.25/0.35 | 0.2875/0.29     |         |

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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN