

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-09-13】

今天人民币兑美元中间价报 7.1030，较上一交易日调升 184 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.0， 1m 成交 4.2/4.25/4.3/4.35/4.4， 2m 成交 4.95， 3m 成交 4.8， 6m 成交 4.8， 9m 成交 4.8125， 1y 成交 4.825。

RR 方面（25d）， 2m 成交-0.05， 3m 成交 0/-0.05。

BF 方面（25d）， 6m 成交 0.28， 1y 成交 0.28。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
09/13/2024		7.1030	184
ATM		Traded	Changes
1w	3.0/5.0	4.0	
2w	3.0/5.0		
1s	3.0/5.0	4.2/4.25/4.3/4.35/4.4	
2s	4.5/5.5	4.95	
3s	4.5/5.5	4.8	
6s	4.5/5.5	4.8	
9s	4.5/5.5	4.8125	
1y	4.5/5.5	4.825	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-1.0/0		
2s	-0.2/0	-0.05	
3s	-0.1/0.1	-0.05/0	
6s	0.1/0.3		
9s	0.3/0.5		
1y	0.4/0.6		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.1/0.4		
1s	0.25/0.35		
2s	0.25/0.35		
3s	0.25/0.35		
6s	0.25/0.35	0.28	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35	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