

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-09-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.0644，较上一交易日调升 339 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 4.8/5.1/5.2/5.4，1m 成交 4.8/4.9，6m 成交 4.875，1y 成交 4.875。

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.7。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.2875，2m 成交 0.29。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
09/20/2024	7.0644	339
ATM	Traded	Changes
1w 4.0/6.0		
2w 4.0/6.0	4.8/5.1/5.2/5.4	
1s 3.0/5.0	4.8/4.9	
2s 4.5/5.5		
3s 4.5/5.5		
6s 4.5/5.5	4.875	
9s 4.5/5.5		
1y 4.5/5.5	4.875	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -1.0/0	-0.7	
2s -0.2/0		
3s -0.1/0.1	-0.1	
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	0.2875	
2s 0.25/0.35	0.29	
3s 0.25/0.35		
6s 0.25/0.35		
9s 0.25/0.35		
1y 0.25/0.35		

Bill Tang

联系人: Rafoel Wang
邮箱: rafoel.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:

以上所发及附加的所有信息 (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