

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-06-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.1135，较上一交易日上升 29 个基点。

期权 ATM 方面，3m 成交 3.2，6m 成交 4.3，9m 成交 4.48/4.5，1y 成交 4.6。

BF 方面 (25d)，1y 成交 0.2875。

RR 方面 (25d)，1w 成交-0.5/-0.475，2w 成交-0.475，2m 成交-0.1，6m 成交 0.375，9m 成交 0.475。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
06/11/2024	7.1135	29
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/3.0		
2w 1.0/3.0		
1s 2.0 /4.0		
2s 2.0 / 4.0		
3s 3.0 / 5.0	3.2	
6s 3.0 / 5.0	4.3	
9s 4.0 / 5.5	4.48/4.5	
1y 4.0 / 5.5	4.6	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.4/0		
2s -0.2/0.1	-0.1	
3s 0/0.2		
6s 0.2/0.5	0.375	
9s 0.4/0.8	0.475	
1y 0.5/0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.25 / 0.35		
2s 0.25 / 0.35		
3s 0.25 / 0.35		
6s 0.25 / 0.35		
9s 0.25 / 0.35		
1y 0.25 / 0.35	0.2875	

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:**

以上所提及的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)