

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-04-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1066，较上一交易日上升 10 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 3.15，3m 成交 3.47/3.5，6m 成交 4.11/4.15，9m 成交 4.725/4.73，1y 成交 4.85。

BF 方面 (25d)，6m 成交 0.305，1y 成交 0.33。

RR 方面 (25d)，1y 成交 0.575。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
04/29/2024	7.1066	10
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.0		
2w 1.0 / 3.0		
1s 2.0 / 5.0		
2s 2.0 / 5.0	3.15	
3s 3.0 / 5.0	3.47/3.5	
6s 3.0 / 5.0	4.11/4.15	
9s 4.0 / 5.5	4.725/4.73	
1y 4.0 / 5.5	4.85	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.5		
2s 0 / 0.6		
3s 0.2 / 0.8		
6s 0.2 / 0.8		
9s 0.4 / 0.8		
1y 0.5 / 0.8	0.575	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4		
3s 0.3 / 0.4		
6s 0.3 / 0.4	0.305	
9s 0.3 / 0.4		
1y 0.3 / 0.4	0.33	

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