



【2024-01-26】

今天人民币兑美元中间价报 7.1074，较上一交易日上调 30 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.3/3.35，2w 成交 3.575，6m 成交 4.4/4.425，9m 成交 4.45，1y 成交 4.575/4.595

FLY 方面（25d），6m 成交 0.255/0.2525，9m 成交 0.255，1y 成交 0.27

RR 方面（25d），3m 成交 0.075

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
01/26/2024		7.1074	30
ATM		Traded	Changes
1w	3.0 / 7.0	3.3/3.35	
2w	3.0 / 6.0	3.575	
1s	3.5 / 5.0		
2s	3.5 / 5.0		
3s	3.5 / 5.0		
6s	4.0 / 5.5	4.4/4.425	
9s	4.0 / 5.5	4.45	
1y	4.0 / 5.5	4.575/4.595	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3		
2s	-0.5 / 0.3		
3s	-0.5/ 0.3	0.075	
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7		
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.4 / 0.6		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4	0.255/0.2525	
9s	0.25 / 0.4	0.255	
1y	0.25 / 0.4	0.27	

Daisy Dai

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