

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2024-06-28】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1268，较上一交易日下降 2 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.35，1m 成交 2.475/2.5，6m 成交 4.25，9m 成交 4.525，1y 成交 4.625/4.6375。

BF 方面 (25d)，9m 成交 0.2775，1y 成交 0.28。

RR 方面 (25d)，1w 成交-0.25，1m 成交-0.15，6m 成交 0.43。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
06/28/2024		7.1268	2
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/3.0	2.35	
2w	1.0/3.0		
1s	2.0 / 4.0	2.475/2.5	
2s	2.0 / 4.0		
3s	3.0 / 5.0		
6s	3.0 / 5.0	4.25	
9s	4.0 / 5.5	4.525	
1y	4.0 / 5.5	4.625/4.6375	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.4/0	-0.15	
2s	0/0.2		
3s	0/0.3		
6s	0.2/0.5	0.43	
9s	0.4/0.8		
1y	0.5/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.25 / 0.35		
6s	0.25 / 0.35		
9s	0.25 / 0.35	0.2775	
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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)