

常规报告系列

收盘日评  
银行间外汇期权市场



【2024-09-05】

今天人民币兑美元中间价报 7.0989，较上一交易日调升 159 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.7/5.8，2w 成交 5.6，1m 成交 5.025/5.05，3m 成交 5.1/5.125/5.15，6m 成交 5.0/5.025，1y 成交 5.0/5.025。

RR 方面（25d），2m 成交-0.25/-0.2，3m 成交 0。

BF 方面（25d），1y 成交 0.2825。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |           |                |         |
|---------------------------|-----------|----------------|---------|
| 09/05/2024                |           | 7.0989         | 159     |
| ATM                       |           | Traded         | Changes |
| 1w                        | 4.5/6.5   | 5.7/5.8        |         |
| 2w                        | 4.5/6.5   | 5.6            |         |
| 1s                        | 4.5/5.5   | 5.025/5.05     |         |
| 2s                        | 5.0/6.0   |                |         |
| 3s                        | 4.5/5.5   | 5.1/5.125/5.15 |         |
| 6s                        | 4.5/5.5   | 5.0/5.025      |         |
| 9s                        | 4.5/5.5   | 5.0            |         |
| 1y                        | 4.5/5.5   | 5.0/5.025      |         |
| 2y                        | 4.5/5.5   |                |         |
| 3y                        | 4.5/5.5   |                |         |
| 25d RR                    |           | Traded         | changes |
| 1s                        | -1.0/0    |                |         |
| 2s                        | -0.3/0    | -0.25/-0.2     |         |
| 3s                        | -0.1/0.1  | 0              |         |
| 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 |                |         |
| 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 | 0.2825         |         |

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