

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-10-28】

今天人民币兑美元中间价报 7.1307，较上一交易日调贬 217 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.85/3.9，3w 成交 7.15，1m 成交 6.4/6.45/6.475，3m 成交 5.85，6m 成交 5.4/5.41。

RR 方面 (25d)，3m 成交 0.2，6m 成交 0.3，1y 成交 0.5。

BF 方面 (25d)，6m 成交 0.285，9m 成交 0.2825/0.284，1y 成交 0.285。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
10/28/2024	7.1307	217
ATM	Traded	Changes
1w 3.0/5.0	3.85/3.9	
2w 6.0/8.0		
1s 5.0/7.0	6.4/6.45/6.475	
2s 5.0/7.0		
3s 5.0/7.0	5.85	
6s 4.5/5.5	5.4/5.41	
9s 4.5/5.5		
1y 4.5/5.5		
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0/0.3		
2s 0/0.3		
3s 0/0.4	0.2	
6s 0.2/0.5	0.3	
9s 0.3/0.5		
1y 0.4/0.6	0.5	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2/0.5		
1s 0.25/0.35		
2s 0.25/0.35		
3s 0.25/0.35		
6s 0.25/0.35	0.285	
9s 0.25/0.35	0.2825/0.284	
1y 0.25/0.35	0.285	

Bill Tang

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