

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

【2024-05-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1106，较上一交易日上升 5 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.8，2w 成交 2.0，1m 成交 2.3，3m 成交 3.145/3.15，9m 成交 4.525，1y 成交 4.62/4.625。

BF 方面（25d），1m 成交 0.285，3m 成交 0.2925/0.293/0.2975，6m 成交 0.2925/0.295/0.2987，9m 成交 0.295，1y 成交 0.295。

RR 方面（25d），1m 成交-0.05，6m 成交 0.4/0.425/0.45，9m 成交 0.5/0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
05/29/2024		7.1106
		5
ATM		Traded
		Changes
1w	1.0/3.0	1.8
2w	1.0/3.0	2.0
1s	2.0 /4.0	2.3
2s	2.0 / 4.0	
3s	3.0 / 5.0	3.145/3.15
6s	3.0 / 5.0	
9s	4.0 / 5.5	4.525
1y	4.0 / 5.5	4.62/4.625
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.2/0	-0.05
2s	-0.2/0.1	
3s	0/0.2	
6s	0.2/0.5	0.4/0.425/0.45
9s	0.4/0.8	0.5/0.525
1y	0.5/0.8	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.25 / 0.35	
1s	0.25 / 0.35	0.285
2s	0.25 / 0.35	
3s	0.25 / 0.35	0.2925/0.293/0.2975
6s	0.25 / 0.35	0.2925/0.295/0.2987
9s	0.25 / 0.35	0.295
1y	0.25 / 0.35	0.295

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