

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-04-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.0968，较上一交易日上升 9 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成家 1.8，2w 成交 1.8/1.9/2.0，3w 成交 2.2，1m 成交 2.65/2.7，2m 成交 3.33/3.35/3.37/3.375，6m 成交 4.125/4.2，9m 成交 4.65，1y 成交 4.825。

RR 方面 (25d)，2m 成交 0.2，3m 成交 0.3，6m 成交 0.4375。

BF 方面 (25d)，2m 成交 0.31，3m 成交 0.31/0.315，6m 成交 0.3225，1y 成交 0.33/0.335。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
04/11/2024	7.0968	9
ATM	Traded	Changes
1w 1.0 / 3.0	1.8	
2w 1.0 / 3.0	1.8/1.9/2.0	
1s 2.0 / 5.0	2.65/2.7	
2s 2.0 / 5.0	3.33/3.35/3.37/3.375	
3s 3.0 / 5.0		
6s 3.0 / 5.0	4.125/4.2	
9s 4.0 / 5.5	4.65	
1y 4.0 / 5.5	4.825	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.4		
2s 0 / 0.4	0.2	
3s 0.2 / 0.6	0.3	
6s 0.2 / 0.8		
9s 0.4 / 0.8		
1y 0.6 / 0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.4		
1s 0.3 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4	0.31	
3s 0.3 / 0.4	0.31/0.315	
6s 0.3 / 0.4	0.3225	
9s 0.3 / 0.4	0.33/0.335	
1y 0.3 / 0.4		

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:

以上所发及附加的所有信息 (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