

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-04-18】

今天人民币兑美元中间价报 7.1020，较上一交易日下降 5 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0/2.1，2m 成交 3.35，3m 成交 3.65/3.75，9m 成交 4.76。

RR 方面 (25d) ,1m 成交 0.3。

BF 方面 (25d) ，2m 成交 0.325，3m 成交 0.32，6m 成交 0.32，9m 成交 0.3325。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
04/18/2024		7.1020	5
ATM		Traded	Changes
1w	1.0 / 3.0	2.0/2.1	
2w	1.0 / 3.0		
1s	2.0 / 5.0		
2s	2.0 / 5.0	3.35	
3s	3.0 / 5.0	3.65/3.75	
6s	3.0 / 5.0		
9s	4.0 / 5.5	4.76	
1y	4.0 / 5.5		
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0 / 0.5	0.3	
2s	0/0.6		
3s	0.2/0.8		
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	0.325	
3s	0.3 / 0.4	0.32	
6s	0.3 / 0.4	0.32	
9s	0.3 / 0.4	0.3325	
1y	0.3 / 0.4		

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