

常规报告系列

收盘日评

银行间外汇期权市场

【2024-06-14】

今天美元兑人民币中间价报 7.1151，较上一交易日上升 29 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.55，1m 成交 2.05/2.075/2.085/2.1，2m 成交 2.55/2.625，3m 成分 2.94/2.95/2.9725/2.975/3.0，6m 成交 4.23。

BF 方面（25d），1w 成交 0.235，2w 成交 0.24，1m 成交 0.265，9m 成交 0.285。

RR 方面（25d），1m 成交-0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
06/14/2024		7.1151	29
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/3.0	1.55	
2w	1.0/3.0		
1s	2.0 /4.0	2.05/2.075/2.085/2.1	
2s	2.0 / 4.0	2.55/2.625	
3s	3.0 / 5.0	2.94/2.95/2.9725/2.975/3.0	
6s	3.0 / 5.0		
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5		
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.4/0	-0.3	
2s	-0.2/0.1		
3s	0/0.2		
6s	0.2/0.5		
9s	0.4/0.8		
1y	0.5/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3	0.235	
1s	0.25 / 0.35	0.265	
2s	0.25 / 0.35		
3s	0.25 / 0.35		
6s	0.25 / 0.35		
9s	0.25 / 0.35	0.285	
1y	0.25 / 0.35		

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