

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2024-08-01】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1323，较上一交易日下降 23 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 3.7/3.9，2m 成交 3.9，3m 成交 3.75/3.8/3.9，1y 成交 4.735，2y 成交 4.835。

BF 方面 (25d)，3w 成交 0.21，3m 成交 0.22。

RR 方面 (25d)，2m 成交-0.6，3m 成交-0.4/-0.375，6m 成交 0.175/0.2。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
08/01/2024	7.1323	-23
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/5.0		
2w 1.0/5.0		
1s 2.0 /5.0	3.7/3.9	
2s 2.0 / 5.0	3.9	
3s 2.0 / 5.0	3.75/3.8/3.9	
6s 3.0 / 5.0		
9s 4.0 / 5.5		
1y 4.0 / 5.5	4.735	
2y 4.0 / 5.5	4.835	
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -1.5/0		
2s -0.6/0	-0.6	
3s -0.4/0	-0.4/-0.375	
6s 0.1/0.3	0.175/0.2	
9s 0.3/0.6		
1y 0.4/0.7		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.1 / 0.3		
1s 0.1 / 0.3		
2s 0.1 / 0.3		
3s 0.1 / 0.3	0.22	
6s 0.2 / 0.3		
9s 0.2 / 0.3		
1y 0.2 / 0.3		

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**