

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-09-03】

今天人民币兑美元中间价报 7.1112，较上一交易日上升 85 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.9/4.95/5.0，2w 成交 5.0/5.05/5.1，1m 成交 4.865/4.875，9m 成交 4.93，1y 成交 4.96/4.97。

RR 方面（25d），3m 成交-0.275/-0.2375，6m 成交 0.1。

BF 方面（25d），2m 成交 0.29，3m 成交 0.3，6m 成交 0.28。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
09/03/2024		7.1112
ATM		85
		Traded
		Changes
1w	1.0/6.0	4.9/4.95/5.0
2w	1.0/6.0	5.0/5.05/5.1
1s	2.0 /6.0	4.865/4.875
2s	2.0 / 6.0	
3s	2.0 / 6.0	
6s	3.0 / 6.0	
9s	4.0 / 5.5	4.93
1y	4.0 / 5.5	4.96/4.97
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-1.5/0	
2s	-1.0/0	
3s	-1.0/0	-0.175/-0.15
6s	-0.1/0.2	0.175
9s	0.2/0.5	
1y	0.3/0.6	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.1 / 0.4	
1s	0.1 / 0.4	
2s	0.1 / 0.4	0.29
3s	0.1 / 0.4	0.3
6s	0.2 / 0.4	0.28
9s	0.2 / 0.4	
1y	0.2 / 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