



【2024-04-03】

今天人民币兑美元中间价报 7.0949，较上一交易日下调 8 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.4，1m 成交 3.125，6m 成交 4.2， 9m 成交 4.7-4.9，1y 成交 4.8-5.0

RR 方面（25d），1m 成交 0.25，1y 成交 0.7

BF 方面（25d），2m 成交 0.31，1y 成交 0.34。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
04/3/2024		7.0949	-8
ATM		Traded	Changes
1w	2.0 / 4.0	2.4	
2w	2.0 / 4.0		
1s	2.0 / 5.0	3.125	
2s	2.0 / 5.0		
3s	3.0 / 5.0		
6s	3.0 / 5.0	4.2	
9s	4.0 / 5.5	4.7-4.9	
1y	4.0 / 5.5	4.8-5.0	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0 / 0.6	0.25	
2s	0/ 0.6		
3s	0/ 0.6		
6s	0 / 0.8		
9s	0.2 / 0.9		
1y	0.3 / 1.0	0.7	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.4		
2s	0.3 / 0.4	0.31	
3s	0.3 / 0.4		
6s	0.3 / 0.4		
9s	0.3 / 0.4		
1y	0.3 / 0.4	0.34	

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