

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-03-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.0946，较上一交易日上升 3 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.2，2w 成交 3.0，1m 成交 3.25，2m 成交 3.4，3m 成交 3.575/3.6，6m 成交 3.975/4.0，1y 成交 4.6/4.625。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.325/0.35，2m 成交 0.3，3m 成交 0.3，9m 成交 0.325。

RR 方面 (25d)，3m 成交 0.35，6m 成交 0.435。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
03/27/2024		7.0946	3
ATM		Traded	Changes
1w	3.0 / 5.0	3.2	
2w	3.0 / 5.0	3.0	
1s	2.0 / 5.0	3.25	
2s	2.0 / 5.0	3.4	
3s	3.0 / 5.0	3.575/3.6	
6s	3.0 / 5.0	3.975/4.0	
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5	4.6/4.625	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0 / 0.6		
2s	0 / 0.6		
3s	0 / 0.6	0.35	
6s	0 / 0.8	0.435	
9s	0 / 0.8		
1y	0 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.4	0.325/0.35	
2s	0.3 / 0.4	0.3	
3s	0.3 / 0.4	0.3	
6s	0.3 / 0.4		
9s	0.3 / 0.4	0.325	
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