



【2024-03-14】

今天人民币兑美元中间价报 7.0974，较上一交易日上升 44 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.1，3m 成交 3.25，6m 成交 3.76/3.7675，1y 成交 4.285/4.29/4.3/4.3125

BF 方面（25d），1w 成交 0.25，1m 成交 0.22，6m 成交 0.235

RR 方面（25d），2m 成交-0.35，3m 成交-0.25

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |             |                       |         |
|---------------------------|-------------|-----------------------|---------|
|                           | 03/14/2024  | 7.0974                | 44      |
|                           | ATM         | Traded                | Changes |
| 1w                        | 1.0 / 4.0   | 2.1                   |         |
| 2w                        | 1.0 / 4.0   |                       |         |
| 1s                        | 2.5 / 5.0   |                       |         |
| 2s                        | 2.5 / 5.0   |                       |         |
| 3s                        | 3.0 / 5.0   | 3.25                  |         |
| 6s                        | 3.0 / 5.0   | 3.76/3.7675           |         |
| 9s                        | 4.0 / 5.5   |                       |         |
| 1y                        | 4.0 / 5.5   | 4.285/4.29/4.3/4.3125 |         |
| 2y                        | 4.0 / 5.5   |                       |         |
| 3y                        | 4.0 / 5.5   |                       |         |
|                           | 25d RR      | Traded                | changes |
| 1s                        | -0.7 / -0.4 |                       |         |
| 2s                        | -0.5 / -0.1 | -0.35                 |         |
| 3s                        | -0.5/ 0.3   | -0.25                 |         |
| 6s                        | 0.2 / 0.6   |                       |         |
| 9s                        | 0.3 / 0.7   |                       |         |
| 1y                        | 0.3 / 0.8   |                       |         |
|                           | 25d FLY     | Traded                | changes |
| 1w                        | 0.2 / 0.3   | 0.25                  |         |
| 1s                        | 0.2 / 0.3   | 0.22                  |         |
| 2s                        | 0.2 / 0.3   |                       |         |
| 3s                        | 0.2 / 0.3   |                       |         |
| 6s                        | 0.2 / 0.3   | 0.235                 |         |
| 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