



【2024-03-05】

今天人民币兑美元中间价报 7.1027，较上一交易日上调 7 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.4，1m 成交 2.35，3m 成交 3.325，6m 成交 3.9/3.95，9m 成交 4.3，1y 成交 4.325/4.365/4.4。

BF 方面（25d），6m 成交 0.235，9m 成交 0.2425

RR 方面（25d），3m 成交-0.1，6m 成交 0.15，1y 成交 0.5/0.525

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
03/05/2024		7.1027	7
ATM		Traded	Changes
1w	1.0 / 4.0	1.4	
2w	1.0 / 4.0		
1s	2.5 / 5.0	2.35	
2s	2.5 / 5.0		
3s	3.0 / 5.0	3.325	
6s	3.0 / 5.0	3.9/3.95	
9s	4.0 / 5.5	4.3	
1y	4.0 / 5.5	4.325/4.365/4.4	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7 / -0.4		
2s	-0.5 / -0.1		
3s	-0.5/ 0.3	-0.1	
6s	0.2 / 0.6	0.15	
9s	0.3 / 0.7		
1y	0.3 / 0.8	0.5/0.525	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.2 / 0.3	0.235	
9s	0.2 / 0.3	0.2425	
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