

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2024-03-29】**

今天人民币兑美元中间价报 7.0950，较上一交易日上升 2 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.0，1m 成交 3.2，2m 成交 3.4，3m 成交 3.68/3.7，6m 成交 4.1，9m 成交 4.6，1y 成交 4.7/4.725。

BF 方面 (25d)，2m 成交 0.3，3m 成交 0.31/0.3125，1y 成交 0.335。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
03/29/2024	7.0950	2
ATM	Traded	Changes
1w 2.0 / 4.0	3.0	
2w 2.0 / 4.0		
1s 2.0 / 5.0	3.2	
2s 2.0 / 5.0	3.4	
3s 3.0 / 5.0	3.68/3.7	
6s 3.0 / 5.0	4.1	
9s 4.0 / 5.5	4.6	
1y 4.0 / 5.5	4.7/4.725	
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		
6s 0 / 0.8		
9s 0 / 0.8		
1y 0 / 0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.2 / 0.4		
2s 0.3 / 0.4	0.3	
3s 0.3 / 0.4	0.31/0.3125	
6s 0.3 / 0.4		
9s 0.3 / 0.4		
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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)