

常规报告系列



收盘日评
银行间外汇期权市场



【2024-02-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1036，较上一交易日下调 39 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.8/1.9， 2w 成交 2.4， 1m 成交 2.7， 3m 成交 3.55， 6m 成交 4.05， 9m 成交 4.4375， 1y 成交 4.48

BF 方面（25d）， 1m 成交 0.22， 2m 成交 0.2,75， 6m 成交 0.24

RR 方面（25d）， 2m 成交-0.225， 3m 成交-0.125， 6m 成交 0.23， 9m 成交 0.45

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/29/2024		7.1036	-39
ATM		Traded	Changes
1w	1.0 /4.0	1.8/1.9	
2w	1.0 / 4.0	2.4	
1s	3.5 / 5.0	2.7	
2s	3.5 / 5.0		
3s	3.5 / 5.0	3.55	
6s	4.0 / 5.5	4.05	
9s	4.0 / 5.5	4.4375	
1y	4.0 / 5.5	4.48	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7 / -0.4		
2s	-0.5 / -0.1	-0.225	
3s	-0.5/ 0.3	-0.125	
6s	0.2 / 0.6	0.23	
9s	0.3 / 0.7	0.45	
1y	0.3 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3	0.22	
2s	0.2 / 0.3	0.2175	
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4	0.24	
9s	0.25 / 0.4		
1y	0.25 / 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