



【2024-03-13】

今天人民币兑美元中间价报 7.0930，较上一交易日下 33 降个基点。

期权 ATM 方面， 2m 成交 2.875/2.9， 3m 成交 3.325， 6m 成交 3.8， 9m 成交 4.25

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.23， 3m 成交 0.23

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.6， 2m 成交-0.45/-0.4， 3m 成交-0.3， 6m 成交 0.05

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |             |            |
|---------------------------|-------------|------------|
| 03/13/2024                |             | 7.0930     |
|                           |             | -33        |
| ATM                       |             | Traded     |
|                           |             | Changes    |
| 1w                        | 1.0 / 4.0   | 1.6        |
| 2w                        | 1.0 / 4.0   |            |
| 1s                        | 2.5 / 5.0   |            |
| 2s                        | 2.5 / 5.0   | 2.875/2.9  |
| 3s                        | 3.0 / 5.0   | 3.325      |
| 6s                        | 3.0 / 5.0   | 3.8        |
| 9s                        | 4.0 / 5.5   | 4.25       |
| 1y                        | 4.0 / 5.5   |            |
| 2y                        | 4.0 / 5.5   |            |
| 3y                        | 4.0 / 5.5   |            |
| 25d RR                    |             | Traded     |
|                           |             | changes    |
| 1s                        | -0.7 / -0.4 | -0.6       |
| 2s                        | -0.5 / -0.1 | -0.45/-0.4 |
| 3s                        | -0.5/ 0.3   | -0.3       |
| 6s                        | 0.2 / 0.6   | 0.05       |
| 9s                        | 0.3 / 0.7   |            |
| 1y                        | 0.3 / 0.8   |            |
| 25d FLV                   |             | Traded     |
|                           |             | changes    |
| 1w                        | 0.2 / 0.3   |            |
| 1s                        | 0.2 / 0.3   |            |
| 2s                        | 0.2 / 0.3   | 0.23       |
| 3s                        | 0.2 / 0.3   | 0.23       |
| 6s                        | 0.2 / 0.3   |            |
| 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