常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-03-06】

今天人民币兑美元中间价报 7.1016，较上一交易日下调 11 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.6，1m 成交 2.25，2m 成交 2.8/2.825，3m 成交 3.275，6m 成交 3.85。

BF 方面（25d），2m 成交 0.215，3m 成交 0.225

RR 方面（25d），1m 成交-0.525，2m 成交-0.35，9m 成交 0.325/0.35，1y 成交 0.45

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	03/06/2024	7.1016	11
	ATM	Traded	Changes
1w	1.0 /4.0	1.6	
2w	1.0 / 4.0		
1s	2.5 / 5.0	2.25	
2s	2.5 / 5.0	2.8/2.825	
3s	3.0 / 5.0	3.275	
6s	3.0 / 5.0	3.85	
9s	4.0 / 5.5		
1y	4.0 / 5.5		
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.7 / -0.4	-0.525	
2s	-0.5 / -0.1	-0.35	
3s	-0.5/ 0.3		
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7	0.325/0.35	
1y	0.3 / 0.8	0.45	
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3	0.215	
3s	0.2 / 0.3	0.225	
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。