



【2024-03-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.0975，较上一交易日上升 1 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0，1m 成交 2.275/2.3，3m 成交 3.15/3.175/3.215/3.22，6m 成交 3.7，9m 成交 4.175，1y 成交 4.275

BF 方面（25d），1m 成交 0.225，1y 成交 0.235

RR 方面（25d），2m 成交-0.35，9m 成交 0.225，1y 成交 0.375

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	03/15/2024	7.0975
	ATM	Traded
		Changes
1w	1.0 /4.0	2.0
2w	1.0 / 4.0	
1s	2.0 /4.0	2.275/2.3
2s	2.0 / 4.0	
3s	3.0 / 5.0	3.15/3.175/3.215/3.22
6s	3.0 / 5.0	3.7
9s	4.0 / 5.5	4.175
1y	4.0 / 5.5	4.275
2y	4.0 / 5.5	
3y	4.0 / 5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.7 / -0.4	
2s	-0.5 / -0.1	-0.35
3s	-0.5/ 0.3	
6s	0 / 0.2	
9s	0.1/ 0.4	0.225
1y	0.2 / 0.5	0.375
25d FLY	Traded	changes
1w	0.2 / 0.3	
1s	0.2 / 0.3	0.225
2s	0.2 / 0.3	
3s	0.2 / 0.3	
6s	0.2 / 0.3	
9s	0.2 / 0.3	
1y	0.2 / 0.3	0.255

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