



【2024-03-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.0969，较上一交易日下调 9 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.6/2.7，1m 成交 2.6/2.625/2.65/2.675/2.7，2m 成交 3.075，3m 成交 3.4

BF 方面（25d），1m 成交 0.225，2m 成交 0.23，3m 成交 0.235

RR 方面（25d），1m 成交-0.6，2m 成交-0.45，3m 成交-0.3，9m 成交 0.25

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
03/11/2024		7.0969
		-9
ATM		Traded
		Changes
1w	1.0 /4.0	2.6/2.7
2w	1.0 / 4.0	
1s	2.5 / 5.0	2.6/2.625/2.65/2.675/2.7
2s	2.5 / 5.0	3.075
3s	3.0 / 5.0	3.4
6s	3.0 / 5.0	
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	-0.6
2s	-0.5 / -0.1	-0.45
3s	-0.5/ 0.3	-0.3
6s	0.2 / 0.6	
9s	0.3 / 0.7	0.25
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	0.225
3s	0.2 / 0.3	0.235
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