

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-03-26】

今天人民币兑美元中间价报 7.0943，较上一交易日下降 53 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.2，2w 成交 3.2，1m 成交 3.2，2m 成交 3.4/3.55，3m 成交 3.55，6m 成交 3.95，9m 成交 4.475/4.5，1y 成交 4.575/4.6。

BF 方面 (25d)，3m 成交 0.28，6m 成交 0.3，9m 成交 0.31，1y 成交 0.31。

RR 方面 (25d)，6m 成交 0.5。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
03/26/2024	7.0943	-53
ATM	Traded	Changes
1w 3.0 / 5.0	3.2	
2w 3.0 / 5.0	3.2	
1s 2.0 / 5.0	3.2	
2s 2.0 / 5.0	3.4/3.55	
3s 3.0 / 5.0	3.55	
6s 3.0 / 5.0	3.95	
9s 4.0 / 5.5	4.475/4.5	
1y 4.0 / 5.5	4.575/4.6	
2y 4.0 / 5.5		
3y 4.0 / 5.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.6		
2s 0 / 0.6		
3s 0 / 0.6		
6s 0 / 0.8	0.5	
9s 0 / 0.8		
1y 0 / 0.8		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.3		
1s 0.2 / 0.3		
2s 0.2 / 0.3		
3s 0.2 / 0.4	0.28	
6s 0.2 / 0.4	0.3	
9s 0.2 / 0.4	0.31	
1y 0.2 / 0.4	0.31	

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:

以上所提及的所有信息 (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