



【2024-02-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.1057，较上一交易日下调 23 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 1.5/1.6，3m 成交 3.6，6m 成交 4.1，9m 成交 4.45，1y 成交 4.475/4.49/4.575

BF 方面（25d），9m 成交 0.25/0.255，1y 成交 0.26/0.2625/0.265

RR 方面（25d），2m 成交-0.225，3m 成交-0.125，9m 成交 0.5

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/27/2024		7.1057	-23
ATM		Traded	Changes
1w	2.0 / 5.0	1.5/1.6	
2w	2.0 / 5.0		
1s	3.5 / 5.0		
2s	3.5 / 5.0		
3s	3.5 / 5.0	3.6	
6s	4.0 / 5.5	4.1	
9s	4.0 / 5.5	4.45	
1y	4.0 / 5.5	4.475/4.49/4.575	
2y	4.5 / 5.5		
3y	4.5 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.5 / 0.3		
2s	-0.5 / 0.3	-0.225	
3s	-0.5/ 0.3	-0.125	
6s	0.2 / 0.6		
9s	0.3 / 0.7	0.45	
1y	0.3 / 0.8	0.5/0.55/0.575	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.25 / 0.4		
9s	0.25 / 0.4	0.25/0.255	
1y	0.25 / 0.4	0.26/0.2625/0.265	

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