



【2024-03-07】

今天人民币兑美元中间价报 7.1002，较上一交易日下调 14 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 2.215，1m 成交 2.3/2.305，2m 成交 2.9，3m 成交 3.3，6m 成交 3.85/3.875，9m 成交 4.3/4.325/4.33，1y 成交 4.3125/4.35/4.375。

BF 方面（25d），1m 成交 0.215

RR 方面（25d），1m 成交-0.525

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
03/06/2024		7.1002
		14
ATM		Traded
		Changes
1w	1.0 /4.0	
2w	1.0 / 4.0	2.215
1s	2.5 / 5.0	2.3/2.305
2s	2.5 / 5.0	2.9
3s	3.0 / 5.0	3.3
6s	3.0 / 5.0	3.85/3.875
9s	4.0 / 5.5	4.3/4.325/4.33
1y	4.0 / 5.5	4.3125/4.35/4.375
2y	4.0 / 5.5	4.3
3y	4.0 / 5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.7 / -0.4	-0.525
2s	-0.5/ -0.1	
3s	-0.5/ 0.3	
6s	0.2 / 0.6	
9s	0.3 / 0.7	
1y	0.3 / 0.8	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.2 / 0.3	
1s	0.2 / 0.3	0.215
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	

Daisy Dai