

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

【2024-03-22】

今天人民币兑美元中间价报 7.1004，较上一交易日上升 62 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.45/4.5，1m 成交 3.9/4.0，2m 成交 3.5/4.0，3m 成交 3.3/3.45/3.9/4.1，6m 成交 3.85/4.05/4.1/4.4，9m 成交 4.7，1y 成交 4.65/4.7/4.75/4.8。

BF 方面（25d），1w 成交 0.25，3m 成交 0.28/0.29，6m 成交 0.2/0.3/0.31。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
03/22/2024		7.1002	62
ATM		Traded	Changes
1w	3.0 / 5.0	4.45/4.5	
2w	3.0 / 5.0		
1s	2.0 / 5.0	3.9/4.0	
2s	2.0 / 5.0	3.5/4.0	
3s	3.0 / 5.0	3.3/3.45/3.9/4.1	
6s	3.0 / 5.0	3.85/4.05/4.1/4.4	
9s	4.0 / 5.5	4.7	
1y	4.0 / 5.5	4.65/4.7/4.75/4.8	
2y	4.0 / 5.5		
3y	4.0 / 5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7 / -0.4		
2s	-0.5 / -0.1		
3s	-0.5/ 0.3		
6s	-0.05 / 0.1		
9s	0.1/ 0.4		
1y	0.2 / 0.5		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.3	0.25	
1s	0.2 / 0.3		
2s	0.2 / 0.3		
3s	0.2 / 0.3	0.28/0.29	
6s	0.2 / 0.3	0.2/0.3/0.31	
9s	0.2 / 0.3		
1y	0.2 / 0.3		

Daisy Dai