

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-12-16】

今天人民币兑美元中间价报 7.1882，较上一交易日调升 6 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.3，2m 成交 5.3，3m 成交 5.65，6m 成交 5.95，9m 成交 6.02/6.07/6.1，1y 成交 6.025/6.05/6.075/6.1/6.135，2y 成交在 6.2/6.25。

BF 方面（25d），2w 成交 0.2，1m 成交 0.25，2m 成交 0.285，6m 成交 0.3075，1y 成交 0.3075。

RR 方面（25d），1m 成交-0.5，2m 成交 0/0.05。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
16/12/2024	7.1882	6
ATM	Traded	Changes
1w	3.0/5.0	
2w	3.0/5.0	
1s	4.0/6.0	4.3
2s	4.0/6.0	5.3
3s	4.0/6.0	5.65
6s	5.0/7.0	5.95
9s	5.0/7.0	6.02/6.07
1y	5.0/7.0	6.025/6.05/6.075
2y	5.0/7.0	6.2/6.25
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/-0.2	-0.5
2s	-0.4/0.0	0/0.05
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	0.25
2s	0.20/0.35	0.285
3s	0.20/0.35	
6s	0.25/0.35	0.3075
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	0.3075

Thanks & Best Regards

姓名 **Bill** 唐铠翊

外汇期权 **FX option**

