

# 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

**【2024-12-09】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1870，较上一交易日调贬 22 个基点。

期权 ATM 方面，3m 成交 5.55，6m 成交 6.025，9m 成交 6.05，1y 成交 6.05/6.08/6.1。

BF 方面 (25d)，3m 成交 0.29，9m 成交 0.305，1y 成交 0.305

RR 方面 (25d)，1m 成交-0.35，2m 成交 0.05，6m 成交 0.575/0.6。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
12/09/2024	7.1870	22
ATM	Traded	Changes
1w	4.0/6.0	
2w	4.0/6.0	
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	5.55
6s	5.0/7.0	6.025
9s	5.0/7.0	6.05
1y	5.0/7.0	6.05/6.08/6.1
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.5/0	-0.35
2s	-0.2/0.2	0.05
3s	0.1/0.4	
6s	0.4/0.7	0.575/0.6
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	0.29
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	0.305
1y	0.25/0.35	0.305