

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-10-23】

今天人民币兑美元中间价报 7.1245，较上一交易日调贬 22 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 6.6，9m 成交 5.35/5.365，1y 成交 5.25/5.275。

RR 方面 (25d)，1m 成交 0.125，3m 成交 0.2，6m 成交 0.35，1y 成交 0.5/0.55。

BF 方面 (25d)，1m 成交 0.26，2m 成交 0.275，6m 成交 0.2875。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
10/23/2024	7.1245	22
ATM	Traded	Changes
1w 3.0/5.0		
2w 6.0/8.0	6.6	
1s 5.0/7.0		
2s 5.0/7.0		
3s 5.0/7.0		
6s 4.5/5.5		
9s 4.5/5.5	5.35/5.365	
1y 4.5/5.5	5.25/5.275	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.3/0.5	0.125	
2s -0.3/0.5		
3s 0/0.5	0.2	
6s 0.2/0.6	0.35	
9s 0.3/0.7		
1y 0.4/0.8	0.5/0.55	
25d FLV	Traded	changes
1w 0.2/0.5		
1s 0.25/0.35	0.26	
2s 0.25/0.35	0.275	
3s 0.25/0.35		
6s 0.25/0.35	0.2875	
9s 0.25/0.35		
1y 0.25/0.35		

Bill Tang

联系人: Rafoel Wang  
邮箱: rafoel.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:**

以上所发及附加的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)