

常规报告系列

收盘日评  
银行间外汇期权市场



【2024-10-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.0731，较上一交易日调升 11 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.925/5.0/5.05/5.1，3m 成交 5.875/5.9，6m 成交 5.35/5.375，9m 成交 5.25，1y 成交 5.15/5.17。

RR 方面（25d），1m 成交-0.035。

BF 方面（25d），1m 成交 0.315，2m 成交 0.325，9m 成交 0.29，1y 成交 0.29。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |           |                    |         |
|---------------------------|-----------|--------------------|---------|
| 10/11/2024                |           | 7.0731             | 11      |
| ATM                       |           | Traded             | Changes |
| 1w                        | 4.0/6.0   | 4.925/5.0/5.05/5.1 |         |
| 2w                        | 4.0/6.0   |                    |         |
| 1s                        | 4.0/5.5   |                    |         |
| 2s                        | 5.0/6.0   |                    |         |
| 3s                        | 5.0/6.0   | 5.875/5.9          |         |
| 6s                        | 4.5/5.5   |                    |         |
| 9s                        | 4.5/5.5   | 5.35/5.375         |         |
| 1y                        | 4.5/5.5   |                    |         |
| 2y                        | 4.5/5.5   | 5.25               |         |
| 3y                        | 4.5/5.5   |                    |         |
| 25d RR                    |           | Traded             | changes |
| 1s                        | -0.3/0.5  | -0.035             |         |
| 2s                        | -0.3/0.5  |                    |         |
| 3s                        | 0/0.5     |                    |         |
| 6s                        | 0.2/0.6   |                    |         |
| 9s                        | 0.3/0.8   |                    |         |
| 1y                        | 0.4/0.8   |                    |         |
| 25d FLY                   |           | Traded             | changes |
| 1w                        | 0.2/0.5   | 0.315              |         |
| 1s                        | 0.25/0.35 |                    |         |
| 2s                        | 0.25/0.35 |                    |         |
| 3s                        | 0.25/0.35 |                    |         |
| 6s                        | 0.25/0.35 |                    |         |
| 9s                        | 0.25/0.35 |                    |         |
| 1y                        | 0.25/0.35 |                    |         |

Bill Tang

联系人：Rafael Wang  
邮箱：rafael.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：

以上所登及附加的所有信息（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