

# 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

【2024-11-18】

今天人民币兑美元中间价报 7.1907，较上一交易日调升 85 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.125/4.2，3m 成交 4.725/4.75，6m 成交 5.025，9m 成交 5.15，1y 成交 5.125/5.15。

BF 方面 (25d)，3w 成交 0.2，1m 成交 0.19，9m 成交 0.2625，1y 成交 0.2625/0.265。

RR 方面 (25d)，3m 成交 0，6m 成交 0.325，9m 成交 0.4/0.4125/0.425。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/18/2024	7.1907	85
ATM	Traded	Changes
1w 3.0/5.0		
2w 3.0/5.0		
1s 4.0/5.0	4.125/4.2	
2s 4.0/5.0		
3s 4.0/5.0	4.725/4.75	
6s 4.5/5.5	5.025	
9s 4.5/5.5	5.15	
1y 4.5/5.5	5.125/5.15	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.5/0		
2s -0.4/0		
3s -0.1/0.1	0	
6s 0.2/0.4	0.325	
9s 0.3/0.5	0.4/0.4125/0.425	
1y 0.4/0.6		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.1/0.2		
1s 0.10/0.30	0.19	
2s 0.20/0.30		
3s 0.20/0.30		
6s 0.25/0.35		
9s 0.25/0.35	0.2625	
1y 0.25/0.35	0.2625/0.265	