

常规报告系列

收盘日评 银行间外汇期权市场

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

【2024-12-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.1843，较上一交易日调升 53 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.8, 2m 成交 5.425, 1y 成交 6.125/6.15。

BF 方面（10D），1 m 成交 0.52/0.53。

BF 方面（25d），1m 成交 0.2, 1m 成交 0.235, 2m 成交 0.28, 3m 成交 0.2925。

RR 方面（25d），1m 成交-0.5/-0.55，6m 成交 0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
12/11/2024		7.1843	-53
ATM		Traded	Changes
1w	4.0/6.0	4.8	
2w	4.0/6.0		
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.425	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0		
9s	5.0/7.0		
1y	5.0/7.0	6.125/6.15	
2y	5.0/6.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.8/-0.2	-0.5/-0.55	
2s	-0.4/0.0		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7	0.525	
9s	0.5/0.7		
1y	0.6/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30	0.2	
1s	0.10/0.30	0.235	
2s	0.20/0.35	0.28	
3s	0.20/0.35	0.2925	
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		