

收盘日评

银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-11-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.1992，较上一交易日调贬 26 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.2，2w 成交 3.9/3.925/4.2/4.3，1m 成交 4.25/4.3，3m 成交 4.75，6m 成交 5.025/5.05，9m 成交 5.1/5.125，1y 成交 5.15。

BF 方面（25d），3m 成交 0.26。

RR 方面（25d），3m 成交 0/0.025/0.05，6m 成交 0.3/0.325，9m 成交 0.4，1y 成交 0.5/0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/15/2024	7.1992
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	4.2
2w	3.0/5.0	3.9/3.925/4.2/4.3
1s	4.0/5.0	4.25/4.3
2s	4.0/5.0	
3s	4.0/5.0	4.75
6s	4.5/5.5	5.025/5.05
9s	4.5/5.5	5.1/5.125
1y	4.5/5.5	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	0/0.025/0.05
6s	0.2/0.4	0.3/0.325
9s	0.3/0.5	0.4
1y	0.4/0.6	0.5/0.525
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.1/0.2	
1s	0.10/0.20	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	0.26
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option