

常规报告系列

收盘日评 银行间外汇期权市场



【2024-11-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.1982，较上一交易日调贬 72 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.1/3.2/3.3，1m 成交 4.075，2m 成交 4.975/5.0，3m 成交 5.1/5.15/5.25/5.3，6m 成交 5.525/5.55/5.575/5.625/5.65，9m 成交 5.55/5.6625，1y 成交 5.55/5.6/5.625/5.7。

RR 方面（25d），9m 成交 0.65/0.675/0.7，1y 成交 0.725/0.75。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/27/2024	7.1982	72
ATM	Traded	Changes
1w 2.0/4.0	3.1/3.2/3.3	
2w 2.0/4.0		
1s 3.0/5.0	4.075	
2s 5.0/6.0	4.975/5.0	
3s 5.0/6.0	5.1/5.15/5.25/5.3	
6s 5.0/6.0	5.525/5.55/5.575/5.625/5.65	
9s 5.0/6.0	5.55/5.6625	
1y 5.0/6.0	5.55/5.6/5.625/5.7	
2y 5.0/6.0		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.7/0.0		
2s -0.4/0.2		
3s 0.2/0.4		
6s 0.4/0.6		
9s 0.6/0.8	0.65/0.675/0.7	
1y 0.7/0.8	0.725/0.75	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.10/0.30		
1s 0.10/0.30		
2s 0.20/0.30		
3s 0.20/0.30		
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

