

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 Broker

【2024-12-25】

今天人民币兑美元中间价报 7.1868，较上一交易日调升 8 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 3.0，2m 成交 5.2，6m 成交 5.75，9m 成交 5.85/5.86，1y 成交 5.9。

RR 方面（25d），2m 成交 0.05，6m 成交 0.525/0.55，9m 成交 0.7。

BF 方面（25d），1m 成交 0.26，6m 成交 0.3，9m 成交 0.3，1y 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	25/12/2024	7.1868	8
	ATM	Traded	Changes
1w	1.0/3.0		
2w	2.0/4.0	3.0	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.2	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.75	
9s	5.0/7.0	5.85/5.86	
1y	5.0/7.0	5.9	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/0.2		
2s	-0.4/0.0		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7	0.525/0.55	
9s	0.5/0.7	0.7	
1y	0.6/0.8		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.26	
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35	0.3	
9s	0.25/0.35	0.3	
1y	0.25/0.35	0.3	