

常规报告系列

收盘日评  
银行间外汇期权市场



【2024-10-22】

今天人民币兑美元中间价报 7.1223，较上一交易日调贬 241 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 4.3，1m 成交 6.585，2m 成交 6.28，3m 成交 5.9，6m 成交 5.4，9m 成交 5.35，1y 成交 5.26/5.275。

RR 方面（25d），3m 成交 0.2，1y 成交 0.6。

BF 方面（25d），2m 成交 0.275，3m 成交 0.2875，1y 成交 0.285。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |            |            |
|---------------------------|------------|------------|
|                           | 10/22/2024 |            |
|                           | ATM        | Traded     |
| Changes                   |            |            |
| 1w                        | 4.0/6.0    |            |
| 2w                        | 4.0/6.0    | 4.3        |
| 1s                        | 5.0/7.0    | 6.585      |
| 2s                        | 5.0/7.0    | 6.28       |
| 3s                        | 5.0/7.0    | 5.9        |
| 6s                        | 4.5/5.5    | 5.4        |
| 9s                        | 4.5/5.5    | 5.35       |
| 1y                        | 4.5/5.5    | 5.26/5.275 |
| 2y                        | 4.5/5.5    |            |
| 3y                        | 4.5/5.5    |            |
| 25d RR                    |            |            |
|                           | Traded     | changes    |
| 1s                        | -0.3/0.5   |            |
| 2s                        | -0.3/0.5   |            |
| 3s                        | 0/0.5      | 0.2        |
| 6s                        | 0.2/0.6    |            |
| 9s                        | 0.3/0.7    |            |
| 1y                        | 0.4/0.8    | 0.6        |
| 25d FLY                   |            |            |
|                           | Traded     | changes    |
| 1w                        | 0.2/0.5    |            |
| 1s                        | 0.25/0.35  |            |
| 2s                        | 0.25/0.35  | 0.275      |
| 3s                        | 0.25/0.35  | 0.2875     |
| 6s                        | 0.25/0.35  |            |
| 9s                        | 0.25/0.35  |            |
| 1y                        | 0.25/0.35  | 0.285      |

Bill Tang

联系人：Rafael Wang  
邮箱：rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：

以上所登及附加的所有信息（以下简称“信息”） 仅用以提供信息，且为保密的和／或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”） 或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、 投资或任何交易策略相关的报价、 出价、 建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、 时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN