

收盘日评

银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2024-11-11】

今天人民币兑美元中间价报 7.1786，较上一交易日调贬 353 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.1/5.5，2w 成交 5.2，1m 成交 4.95，2m 成交 4.86，3m 成交 4.925，6m 成交 4.925/4.93/4.96，9m 成交 4.95/4.96，1y 成交 4.97/4.975/4.98/4.99/5.025。

BF 方面（25d），1w 成交 0.17/0.175，1m 成交 0.18，2m 成交 0.24，6m 成交 0.2575，1y 成交 0.26。

RR 方面（25d），2m 成交-0.075，3m 成交 0.08，6m 成交 0.3/0.315。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/11/2024	7.1786	353
ATM	Traded	Changes
1w	3.0/7.0	5.1/5.5
2w	3.0/7.0	5.2
1s	5.0/6.0	4.95
2s	4.0/6.0	4.86
3s	4.0/6.0	4.925
6s	4.5/5.5	4.925/4.93/4.96
9s	4.5/5.5	4.95/4.96
1y	4.5/5.5	4.97/4.975/4.98/4.99/5.025
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.2/0.2	
2s	-0.2/0.2	-0.075
3s	0/0.2	0.08
6s	0.2/0.4	0.3/0.315
9s	0.3/0.5	
1y	0.4/0.6	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.1/0.2	0.17/0.175
1s	0.20/0.30	0.18
2s	0.20/0.30	0.24

3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.2575
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards