常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-11-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.1935，较上一交易日调贬 24 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.4，1m 成交 3.95，2m 成交 4.225/4.25/4.275，3m 成交 4.6，6m 成交 4.975/5.0，9m 成交 5.1/5.11，1y 成交 5.12/5.13/5.135。

BF 方面（25d），6m 成交 0.264/0.265，1y 成交 0.265。

RR 方面（25d），9m 成交 0.475。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/20/2024	ATM	7.1935 Traded	24 Changes
1w	2.0/4.0	3.4	
2w	2.0/4.0		
1s	3.0/5.0	3.95	
2s	4.0/5.0	4.225/4.25/4.275	
3s	4.0/5.0	4.6	
6s	4.5/5.5	4.975/5.0	
9s	4.5/5.5	5.1/5.11	
1y	4.5/5.5	5.12/5.13/5.135	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.7/-0.2		
2s	-0.4/0		
3s	-0.1/0.1		
6s	0.2/0.4		
9s	0.3/0.5	0.475	
1y	0.4/0.6		
	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	0.264	
9s	0.25/0.35	0.265	
1y	0.25/0.35	0.265	