

常规报告系列

收盘日评  
银行间外汇期权市场



【2024-10-16】

今天人民币兑美元中间价报 7.1191，较上一交易日调贬 361 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.75/4.8，1m 成交 6.85，1y 成交 5.1625/5.175。

RR 方面（25d），2w 成交-0.25/-0.2，3w 成交-0.1/0.1，1m 成交 0.125。

BF 方面（25d），1m 成交 0.295/0.3，6m 成交 0.29，1y 成交 0.2875/0.29。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |            |              |
|---------------------------|------------|--------------|
|                           | 10/16/2024 | 7.1191       |
|                           | ATM        | Traded       |
|                           |            | Changes      |
| 1w                        | 4.0/6.0    | 4.75/4.8     |
| 2w                        | 4.0/6.0    |              |
| 1s                        | 5.0/7.0    | 6.85         |
| 2s                        | 5.0/7.0    |              |
| 3s                        | 5.0/6.0    |              |
| 6s                        | 4.5/5.5    |              |
| 9s                        | 4.5/5.5    |              |
| 1y                        | 4.5/5.5    | 5.1625/5.175 |
| 2y                        | 4.5/5.5    |              |
| 3y                        | 4.5/5.5    |              |
|                           | 25d RR     | Traded       |
|                           |            | changes      |
| 1s                        | -0.3/0.5   | 0.0125       |
| 2s                        | -0.3/0.5   |              |
| 3s                        | 0/0.5      |              |
| 6s                        | 0.2/0.6    |              |
| 9s                        | 0.3/0.8    |              |
| 1y                        | 0.4/0.8    |              |
|                           | 25d FLY    | Traded       |
|                           |            | changes      |
| 1w                        | 0.2/0.5    |              |
| 1s                        | 0.25/0.35  | 0.295/0.3    |
| 2s                        | 0.25/0.35  |              |
| 3s                        | 0.25/0.35  |              |
| 6s                        | 0.25/0.35  | 0.29         |
| 9s                        | 0.25/0.35  |              |
| 1y                        | 0.25/0.35  | 0.2875/0.29  |

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：

以上所含及附加的所有信息（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