

收盘日评 银行间外汇期权市场



【2024-11-13】

今天人民币兑美元中间价报 7.1991，较上一交易日调贬 64 个基点。

期权 ATM 方面， 3m 成交 4.885/4.9， 6m 成交 5.0， 9m 成交 5.02/5.025/5.05， 1y 成交 5.0/5.015/5.02/5.03/5.045/5.05/5.075/5.1。

BF 方面（25d）， 1w 成交 0.175， 6m 成交 0.26， 9m 成交 0.2575。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.2/-0.175， 2m 成交-0.05， 6m 成交 0.3， 9m 成交 0.3875。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/13/2024		7.1991
ATM		64
		Traded
		Changes
1w	3.0/7.0	
2w	3.0/7.0	
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	4.885/4.9
6s	4.5/5.5	5.0
9s	4.5/5.5	5.02/5.025/5.05
1y	4.5/5.5	5.0/5.015/5.02/5.03/5.045/5.05/5.075/5.1
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.2/0.2	-0.2/-0.175
2s	-0.2/0.2	-0.05
3s	0/0.2	
6s	0.2/0.4	0.3
9s	0.3/0.5	0.3875
1y	0.4/0.6	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.1/0.2	0.175
1s	0.20/0.30	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.26
9s	0.25/0.35	0.2575
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards