

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



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

【2024-11-08】

今天人民币兑美元中间价报 7.1433，较上一交易日调升 226 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.85/6.0/6.1，2w 成交 5.5/5.9，1m 成交 5.1/5.125/5.15/5.2，2m 成交 4.9，6m 成交 4.9125，9m 成交 4.9375，1y 成交 4.935/4.95。

BF 方面 (25d)，1w 成交 0.17，2m 成交 0.24。

RR 方面 (25d)，2m 成交 0，3m 成交 0.1/0.11，6m 成交 0.3，1y 成交 0.5。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/08/2024	7.1433	226
ATM	Traded	Changes
1w 3.0/7.0	5.85/6.0/6.1	
2w 3.0/7.0	5.5/5.9	
1s 5.0/6.0	5.1/5.125/5.15/5.2	
2s 4.0/6.0	4.9	
3s 4.0/6.0		
6s 4.5/5.5	4.9125	
9s 4.5/5.5	4.9375	
1y 4.5/5.5	4.935/4.95	
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	
3s 0/0.2	0.1/0.11	
6s 0.2/0.4	0.3	
9s 0.3/0.5		
1y 0.4/0.6	0.5	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.1/0.2	0.17	
1s 0.20/0.30		
2s 0.20/0.30	0.24	
3s 0.20/0.30		
6s 0.25/0.35		
9s 0.25/0.35		
1y 0.25/0.35		