【2024-12-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.1893，较上一交易日调升 4 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.9，1m 成交 4.435/4.45，2m 成交 5.285/5.3, 3m 成交 5.6，6m 成交 5.825，9m 成交 5.9，1y 成交 5.925。

RR 方面（25d）， 2w 成交-0.375, 3m 成交 0.125。

BF 方面（25d），1w 成交 0.24，1m 成交 0.265，2m 成交 0.285，3m 成交 0.29，9m 成交 0.297。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	27/12/2024	7.1893	-4
	ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	2.9	
2w	2.0/4.0		
1s	4.0/6.0	4.435/4.45	
2s	4.0/6.0	5.285/5.3	
3s	4.0/6.0	5.6	
6s	5.0/7.0	5.825	
9s	5.0/7.0	5.9	
1y	5.0/7.0	5.925	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/0.2		
2s	-0.4/0.0		
3s	0.0/0.4	0.125	
6s	0.4/0.7		
9s	0.6/0.75		
1y	0.65/0.8		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30	0.24	
1s	0.10/0.30	0.265	
2s	0.20/0.35	0.285	
3s	0.20/0.35	0.29	
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.297	
1y	0.25/0.35		