



【2024-12-12】

今天人民币兑美元中间价报 7.1854，较上一交易日调升 11 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.9, 2w 成交 4.5, 2m 成交 5.575/5.625, 9m 成交 6.15/6.17/6.175, 1y 成交 6.2/6.225。

BF 方面（25d），1w 成交 0.22， 2m 成交 0.28。

RR 方面（25d），1m 成交-0.3， 2m 成交 0, 1y 成交 0.8。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
12/12/2024		7.1854	11
ATM		Traded	Changes
1w	4.0/6.0	4.9	
2w	4.0/6.0	4.5	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.575/5.625	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0		
9s	5.0/7.0	6.15/6.17/6.175	
1y	5.0/7.0	6.2/6.225	
2y	5.0/6.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.8/-0.2	-0.3	
2s	-0.4/0.0	0	
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7		
9s	0.5/0.7		
1y	0.6/0.8	0.8	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30	0.22	
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35	0.28	
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		