



【2024-12-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.1901，较上一交易日调贬 10 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.0/2.3/2.6，2w 成交 2.7/3.0，1m 成交 4.05/4.1，2m 成交 5.0，6m 成交 5.8/5.825，9m 成交 5.85，1y 成交 5.9。

BF 方面（25d），2m 成交 0.2775，9m 成交 0.2975。

RR 方面（25d），1w 成交-0.6，1m 成交-0.3/-0.2，6m 成交 0.5875/0.6，9m 成交 0.7。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	20/12/2024	7.1901
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	2.0/2.3/2.6
2w	3.0/5.0	2.7/3.0
1s	4.0/6.0	4.05/4.1
2s	4.0/6.0	5.0
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	5.8/5.825
9s	5.0/7.0	5.85
1y	5.0/7.0	5.9
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/0.2	-0.3/-0.2
2s	-0.4/0.0	
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	0.5875/0.6
9s	0.5/0.7	0.7
1y	0.6/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.2775
3s	0.20/0.35	
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	0.2975
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

