



【2024-12-24】

今天人民币兑美元中间价报 7.1876，较上一交易日调贬 6 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.3, 2m 成交 5.2, 3m 成交 5.5, 6m 成交 5.8, 9m 成交 5.9, 1y 成交 5.925。

RR 方面（25d）， 2w 成交-0.45/-0.4, 6m 成交 0.5305/0.546/0.55, 9m 成交 0.7。

BF 方面（25d）， 1m 成交 0.26, 9m 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
24/12/2024		7.1876	6
ATM		Traded	Changes
1w	3.0/5.0		
2w	3.0/5.0		
1s	4.0/6.0	4.3	
2s	4.0/6.0	5.2	
3s	4.0/6.0	5.5	
6s	5.0/7.0	5.8	
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		
6s	0.4/0.7	0.5305/0.546/0.55	
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	0.26	
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.3	
1y	0.25/0.35		