

**【2024-02-06】**

 今天人民币兑美元中间价报7.1082，较上一交易日下调12个基点。

期权ATM方面，2w成交3.05，3m成交4.15，9m成交4.5/4.575/4.59,1y成交4.6/4.625

FLY方面（25d），1m/2m成交0.22，2m成交0.231y成交0.2675

RR方面（25d），9m成交0.475，

|  |
| --- |
|  |
|  |
|   | **CFETS-NEX FX OPTION RECAP** |   |
|  | **02/06/2024** |  | **7.1082** | **12** |   |
|   |  | **ATM** |  | **Traded** | **Changes** |   |
|   | **1w** | 3.0 /5.0 |  |  |   |   |
|   | **2w** | 3.0 / 5.0 |  | 3.05 |  |  |
|   | **1s** | 3.5 / 5.0 |  |  |   |   |
|   | **2s** | 3.5 / 5.0 |  |  |   |   |
|   | **3s** | 3.5 / 5.0 |  | 4.15 |   |   |
|   | **6s** | 4.0 / 5.5 |  |  |   |   |
|   | **9s** | 4.0 / 5.5 |  | 4.5/4.575/4.59 |   |   |
|   | **1y** | 4.0 /  5.5 |  | 4.6/4.625 |   |  |
|   | **2y** | 4.5  /  5.5 |   |  |   |   |
|   | **3y** | 4.5  /  5.5 |   |   |   |   |
|   |  | **25d RR** |  | **Traded** | **changes** |   |
|   | **1s** | -0.5  /  0.3 |   |  |   |   |
|   | **2s** | -0.5 /  0.3 |   |  |   |   |
|   | **3s** | -0.5/  0.3 |   |  |   |   |
|   | **6s** | 0.2 /  0.6 |   |  |   |   |
|   | **9s** | 0.3  /  0.7 |   | 0.475 |   |   |
|   | **1y** | 0.3  /  0.8 |    |  |   |   |
|   |  | **25d FLY** |  | **Traded** | **changes** |   |
|   | **1w** | 0.2  /  0.3 |   |  |   |   |
|   | **1s** | 0.2  /  0.3 |   | 0.22 |   |   |
|   | **2s** | 0.2  /  0.3 |   | 0.22 |   |   |
|   | **3s** | 0.2  /  0.3 |   | 0.23 |   |   |
|   | **6s** | 0.25  /  0.4 |   |  |   |   |
|   | **9s** | 0.25  /  0.4 |   |  |   |   |
|   | **1y** | 0.25  /  0.4 |   |  |   |   |
|  |  |  |  |  |  |  |

Daisy Dai

   