



【2024-12-10】

今天人民币兑美元中间价报 7.1896，较上一交易日调贬 26 个基点。

期权 ATM 方面，9m 成交 6.075，1y 成交 6.095/6.1。

BF 方面（25d），2m 成交 0.28，3m 成交 0.295，6m 成交 0.305，9m 成交 0.3075，1y 成交 0.31。

RR 方面（25d），1m 成交-0.5/-0.4，2m 成交-0.2/-0.1，3m 成交 0.15，6m 成交 0.525，1y 成交 0.675/0.7。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	12/10/2024	
	7.1896	26
	ATM	Traded
		Changes
1w	4.0/6.0	
2w	4.0/6.0	
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	
9s	5.0/7.0	6.075
1y	5.0/7.0	6.095/6.1
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/-0.2	-0.5/-0.4
2s	-0.4/0.0	-0.2/-0.1
3s	0.0/0.4	0.15
6s	0.4/0.7	0.525
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	0.675/0.7
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.28
3s	0.20/0.35	0.295
6s	0.25/0.35	0.305
9s	0.25/0.35	0.3075
1y	0.25/0.35	0.31