



【2024-11-25】

今天人民币兑美元中间价报 7.1918，较上一交易日调升 24 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 4.5，3m 成交 4.875/4.9，6m 成交 5.215/5.225，9m 成交 5.3，1y 成交 5.325/5.35。

BF 方面（25d），1w 成交 0.1875，3m 成交 0.2625/0.265，6m 成交 0.2675/0.27/0.2725，9m 成交 0.2725，1y 成交 0.27/0.2725。

RR 方面（25d），3m 成交 0.25。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/25/2024	7.1918	-24
ATM	Traded	Changes
1w 2.0/4.0		
2w 2.0/4.0		
1s 3.0/5.0		
2s 4.0/5.0	4.5	
3s 4.0/5.0	4.875/4.9	
6s 4.5/5.5	5.215/5.225	
9s 4.5/5.5	5.3	
1y 4.5/5.5	5.325/5.35	
2y 4.5/5.5		
3y 4.5/5.5		
25d RR	Traded	changes
1s -0.7/-0.2		
2s -0.4/0		
3s 0.1/0.3	0.25	
6s 0.3/0.4		
9s 0.4/0.5		
1y 0.5/0.6		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.10/0.30	0.1875	
1s 0.10/0.30		
2s 0.20/0.30		
3s 0.20/0.30	0.2625/0.265	
6s 0.25/0.35	0.2675/0.27/0.2725	
9s 0.25/0.35	0.2725	
1y 0.25/0.35	0.27/0.2725	

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

上海市杨浦区荆州路 27 号（200082）

27 Jingzhou Road, Yangpu District, Shanghai (200082)

Phone: 86-21-38617888 | Mobile: 86-13611111111 | Fax: 86-21-50472092 | Email: XXXX.XXXX@cfets-nex.com.cn

Website: www.cfets-nex.com.cn

