



【2024-12-31】

今天人民币兑美元中间价报 7.1884，较上一交易日调升 5 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 4.1，2m 成交 5.25/5.3，3m 成交 5.5，6m 成交 5.7/5.725/5.765，9m 成交 5.77/5.775/5.825，1y 成交 5.815/5.825。

RR 方面（25d）， 6m 成交 0.575，9m 成交 0.725。

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.29，6m 成交 0.3025。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
31/12/2024	7.1884	5
ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	
2w	2.0/5.0	4.1
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	5.25/5.3
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	5.7/5.725/5.765
9s	5.0/7.0	5.77/5.775/5.825
1y	5.0/7.0	5.815/5.825
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/0.2	
2s	-0.2/0.2	
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	0.575
9s	0.6/0.75	0.725
1y	0.65/0.8	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.29
3s	0.20/0.35	
6s	0.25/0.35	0.3025
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

