



【2024-12-26】

今天人民币兑美元中间价报 7.1897，较上一交易日调贬 29 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 2.5，2w 成交 3.4，2m 成交 5.25/5.3，6m 成交 5.8，1y 成交 5.925/5.95。

RR 方面（25d）， 6m 成交 0.525/0.55，9m 成交 0.7，1y 成交 0.75。

BF 方面（25d）， 1w 成交 0.23，6m 成交 0.299/0.3，9m 成交 0.2975/0.298，1y 成交 0.2975/0.299。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
26/12/2024		7.1897	29
ATM		Traded	Changes
1w	1.0/3.0	2.5	
2w	2.0/4.0	3.4	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.25/5.3	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.8	
9s	5.0/7.0		
1y	5.0/7.0	5.925/5.95	
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	0.525/0.55	
9s	0.6/0.75	0.7	
1y	0.65/0.8	0.75	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30	0.23	
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35	0.299/0.3	
9s	0.25/0.35	0.2975/0.298	
1y	0.25/0.35	0.2975/0.299	