



【2024-11-07】

今天人民币兑美元中间价报 7.1659，较上一交易日调贬 666 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.2，1m 成交 5.1/5.15/5.2/5.3/5.4/5.45， 2m 成交 4.85，3m 成交 4.875，6m 成交 4.875/4.9/4.95/4.955，9m 成交 4.875/4.9/4.9125，1y 成交 4.9/4.925/4.95。

BF 方面（25d），1w 成交 0.155/0.165，2m 成交 0.245。

RR 方面（25d），2m 成交 0.1/0.15

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/07/2024	7.1659
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/7.0	6.2
2w	3.0/7.0	
1s	5.0/6.0	5.1/5.15/5.2/5.3/5.4/5.45
2s	4.0/6.0	4.85
3s	4.0/6.0	4.875
6s	4.5/5.5	4.875/4.9/4.95/4.955
9s	4.5/5.5	4.875/4.9/4.9125
1y	4.5/5.5	4.9/4.925/4.95
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.2/0.2	
2s	-0.2/0.2	0.1/0.15
3s	0.1/0.35	
6s	0.2/0.45	
9s	0.3/0.55	
1y	0.4/0.65	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.1/0.2	0.155/0.165
1s	0.20/0.30	
2s	0.20/0.30	0.245
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	