



【2024-11-21】

今天人民币兑美元中间价报 7.1934，较上一交易日调升 1 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.2，1m 成交 3.85/3.875/3.95，2m 成交 4.4/4.45，6m 成交 5.1/5.125，9m 成交 5.175，1y 成交 5.2/5.225。

BF 方面（25d），1m 成交 0.19/0.195，2m 成交 0.245，9m 成交 0.265。

RR 方面（25d），1m 成交-0.55，3m 成交 0.1/0.125，6m 成交 0.375。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/21/2024		7.1934	1
ATM		Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.2	
2w	2.0/4.0		
1s	3.0/5.0	3.85/3.875/3.95	
2s	4.0/5.0	4.4/4.45	
3s	4.0/5.0		
6s	4.5/5.5	5.1/5.125	
9s	4.5/5.5	5.175	
1y	4.5/5.5	5.2/5.225	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7/-0.2	-0.55	
2s	-0.4/0		
3s	0/0.2	0.125	
6s	0.3/0.4	0.375	
9s	0.4/0.5		
1y	0.5/0.6		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.19/0.195	
2s	0.20/0.30	0.245	
3s	0.20/0.30		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.265	
1y	0.25/0.35		