



【2024-11-26】

今天人民币兑美元中间价报 7.1910，较上一交易日调升 8 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.25/3.3/3.4，1m 成交 4.075，6m 成交 5.35/5.375/5.475，9m 成交 5.375，1y 成交 5.4/5.425/5.45/5.475/5.5/5.525。

RR 方面（25d），3m 成交 0.275/0.29/0.3/0.325，6m 成交 0.45/0.5/0.55，1y 成交 0.675/0.7。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/26/2024	
	ATM	Traded
1w	2.0/4.0	3.25/3.3/3.4
2w	2.0/4.0	
1s	3.0/5.0	4.075
2s	4.0/5.0	
3s	4.0/5.0	
6s	4.5/5.5	5.35/5.375/5.475
9s	4.5/5.5	5.375
1y	4.5/5.5	5.4/5.425/5.45/5.475/5.5/5.525
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
1s	-0.7/-0.2	
2s	-0.4/0	
3s	0.2/0.4	0.275/0.29/0.3/0.325
6s	0.4/0.6	0.45/0.5/0.55
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	0.675/0.7
	25d FLY	Traded
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	
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

