



【2024-11-06】

今天人民币兑美元中间价报 7.0993，较上一交易日调升 23 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 7.0，1m 成交 5.5/5.55/5.75，2m 成交 4.95/5.0/5.1/5.15/5.2，3m 成交 4.925/5.0/5.05/5.15/5.2/5.35/5.5，6m 成交 4.9/4.95/5.0/5.1，9m 成交 4.95/5.0，1y 成交 4.9/4.95。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/06/2024		7.0993
ATM		23
		Traded
		Changes
1w	5.0/10.0	
2w	5.0/10.0	7.0
1s	5.0/7.0	5.5/5.55/5.75
2s	4.0/6.0	4.95/5.0/5.1/5.15/5.2
3s	4.0/6.0	4.925/5.0/5.05/5.15/5.2/5.35/5.5
6s	4.5/5.5	4.9/4.95/5.0/5.1
9s	4.5/5.5	4.95/5.0
1y	4.5/5.5	4.9/4.95
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.2/0.2	
2s	-0.2/0.2	
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	0.1/0.25	
1s	0.20/0.30	
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	