



【2024-11-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1877，较上一交易日调升 17 个基点。

期权 ATM 方面， 3m 成交 5.15， 6m 成交 5.6， 1y 成交 5.625/5.65， 2y 成交 5.725/5.75。

BF 方面（25d）， 9m 成交 0.295， 1y 成交 0.29/0.2925/0.295。

RR 方面（25d）， 6m 成交 0.475/0.5， 9m 成交 0.6/0.625/0.65。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/29/2024	
	7.1877	-17
	ATM	Traded
		Changes
1w	2.0/4.0	
2w	2.0/4.0	
1s	3.0/5.0	
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	5.15
6s	5.0/6.0	5.6
9s	5.0/6.0	
1y	5.0/6.0	5.625/5.65
2y	5.0/6.0	5.725/5.75
3y	4.5/5.5	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.7/0.0	
2s	-0.4/0.2	
3s	0.2/0.4	
6s	0.4/0.6	0.475/0.5
9s	0.6/0.8	0.6/0.625/0.65
1y	0.7/0.8	
25d FLV	Traded	changes
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	0.295
1y	0.25/0.35	0.29/0.2925/0.295

Thanks & Best Regards

姓名 **Bill** 唐锐翊

外汇期权 **FX option**

上海市杨浦区荆州路 27 号 （200082）

27 Jingzhou Road, Yangpu District, Shanghai (200082)

Phone: 86-21-38617888 | Mobile: 86-13611111111 | Fax: 86-21-50472092 | Email: XXXX.XXXX@cfets-nex.com.cn

Website: www.cfets-nex.com.cn

