



【2024-12-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.1891，较上一交易日调升 9 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 5.225, 3m 成交 5.5/5.65, 6m 成交 5.9, 9m 成交 5.965, 1y 成交 5.98/6.0。

BF 方面（25d），1m 成交 0.245, 3m 成交 0.2875，6m 成交 0.3075，9m 成交 0.3025/0.305, 1y 成交 0.3075。

RR 方面（25d），1m 成交-0.5, 2m 成交 0.05, 3m 成交 0.2，6m 成交 0.5625/0.575/0.6。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	17/12/2024	
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	
2w	3.0/5.0	
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	5.225
3s	4.0/6.0	5.5/5.65
6s	5.0/7.0	5.9
9s	5.0/7.0	5.965
1y	5.0/7.0	5.98/6.0
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/-0.2	-0.5
2s	-0.4/0.0	0.05
3s	0.0/0.4	0.2
6s	0.4/0.7	0.5625/0.575/0.6
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	0.245
2s	0.20/0.35	
3s	0.20/0.35	0.2875
6s	0.25/0.35	0.3075
9s	0.25/0.35	0.3025/0.305
1y	0.25/0.35	0.3075

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

www.cfets-nex.com.cn

