



【2024-12-04】

今天人民币兑美元中间价报 7.1934，较上一交易日调升 62 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.8，1m 成交 4.6/4.7，2m 成交 5.15，3m 成交 5.375，6m 成交 6.0，9m 成交 5.98/5.995/6.025，1y 成交 6.01/6.025/6.05/6.1。

BF 方面（25d），2m 成交 0.28，3m 成交 0.29，6m 成交 0.3/0.305，1y 成交 0.2975/0.305。

RR 方面（25d），1m 成交-0.1/-0.05/0。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |            |                     |
|---------------------------|------------|---------------------|
|                           | 12/04/2024 | 7.1934              |
|                           | ATM        | Traded              |
|                           |            | Changes             |
| 1w                        | 4.0/6.0    | 4.8                 |
| 2w                        | 4.0/6.0    |                     |
| 1s                        | 4.0/6.0    | 4.6/4.7             |
| 2s                        | 4.0/6.0    | 5.15                |
| 3s                        | 4.0/6.0    | 5.375               |
| 6s                        | 5.0/7.0    | 6.0                 |
| 9s                        | 5.0/7.0    | 5.98/5.995/6.025    |
| 1y                        | 5.0/7.0    | 6.01/6.025/6.05/6.1 |
| 2y                        | 5.0/6.0    |                     |
| 3y                        | 4.5/5.5    |                     |
|                           | 25d RR     | Traded              |
|                           |            | changes             |
| 1s                        | -0.2/0.2   | -0.1/-0.05/0        |
| 2s                        | -0.2/0.3   |                     |
| 3s                        | 0.2/0.6    |                     |
| 6s                        | 0.4/0.8    |                     |
| 9s                        | 0.6/1.0    |                     |
| 1y                        | 0.7/1.0    |                     |
|                           | 25d FLY    | Traded              |
|                           |            | changes             |
| 1w                        | 0.10/0.30  |                     |
| 1s                        | 0.10/0.30  |                     |
| 2s                        | 0.20/0.30  | 0.28                |
| 3s                        | 0.20/0.30  | 0.29                |
| 6s                        | 0.25/0.35  | 0.3/0.305           |
| 9s                        | 0.25/0.35  |                     |
| 1y                        | 0.25/0.35  | 0.2975/0.305        |

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](mailto:XXXX.XXXX@cfets-nex.com.cn)

Website: [www.cfets-nex.com.cn](http://www.cfets-nex.com.cn)

---

