



【2024-11-12】

今天人民币兑美元中间价报 7.1927，较上一交易日调贬 141 个基点。

期权 ATM 方面， 2w 成交 5.3， 1m 成交 5.205/5.23， 2m 成交 4.98/5.005/5.05， 3m 成交 5.06/5.075/5.1， 6m 成交 5.08/5.1/5.115， 9m 成交 5.125/5.14， 1y 成交 5.1/5.125/5.13/5.135/5.1625/5.165。

BF 方面（25d）， 1m 成交 0.18/0.185， 6m 成交 0.26。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.1， 2m 成交-0.04/-0.05， 3m 成交 0.1/0.11， 6m 成交 0.32， 9m 成交 0.425， 1y 成交 0.525。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/12/2024	7.1927
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/7.0	
2w	3.0/7.0	5.3
1s	4.0/6.0	5.205/5.23
2s	4.0/6.0	4.98/5.005/5.05
3s	4.0/6.0	5.06/5.075/5.1
6s	4.5/5.5	5.08/5.1/5.115
9s	4.5/5.5	5.125/5.14
1y	4.5/5.5	5.1/5.125/5.13/5.135/5.1625/5.165
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.2/0.2	-0.1
2s	-0.2/0.2	-0.05/-0.04
3s	0/0.2	0.1/0.11
6s	0.2/0.4	0.32
9s	0.3/0.5	0.425
1y	0.4/0.6	0.525
	25d FLV	Traded
		changes
1w	0.1/0.2	
1s	0.20/0.30	0.18/0.185
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.26
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards