



【2024-12-13】

今天人民币兑美元中间价报 7.1876，较上一交易日调升 22 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.0/4.2, 2w 成交 3.9/4.0/4.2, 3w 成交 4.0/4.1/4.2/4.4, 1m 成交 4.25/4.3/4.325/4.35/4.4, 3m 成交 5.75, 6m 成交 6.025, 9m 成交 6.07, 1y 成交 6.1/6.125/6.175。

BF 方面（25d），1w 成交 0.21/0.22, 2w 成交 0.21， 1m 成交 0.24/0.25, 6m 成交 0.3075。

RR 方面（25d），1m 成交-0.4。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	12/13/2024	7.1876	22
	ATM	Traded	Changes
1w	4.0/6.0	4.0/4.2	
2w	4.0/6.0	3.9/4.0/4.2	
1s	4.0/6.0	4.25/4.3/4.325/4.35/4.4	
2s	4.0/6.0		
3s	4.0/6.0	5.75	
6s	5.0/7.0	6.025	
9s	5.0/7.0	6.07	
1y	5.0/7.0	6.1/6.125/6.175	
2y	5.0/6.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/-0.2	-0.4	
2s	-0.4/0.0		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7		
9s	0.5/0.7		
1y	0.6/0.8		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30	0.21/0.22	
1s	0.10/0.30	0.24/0.25	
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35	0.3075	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		