



【2024-12-02】

今天人民币兑美元中间价报 7.1865，较上一交易日调升 12 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.5/3.65，2w 成交 3.7/4.0，1m 成交 4.1，2m 成交 4.9/5.0/5.05，6m 成交 5.65/5.675，1y 成交 5.725。

BF 方面（25d），1m 成交 0.195，6m 成交 0.295。

RR 方面（25d），1m 成交-0.1，2m 成交 0.05。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
12/02/2024		7.1865	12
ATM		Traded	Changes
1w	2.0/5.0	3.5/3.65	
2w	2.0/5.0	3.7/4.0	
1s	3.0/5.0	4.1	
2s	4.0/6.0	4.9/5.0/5.05	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/6.0	5.65/5.675	
9s	5.0/6.0		
1y	5.0/6.0	5.725	
2y	5.0/6.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.3/0.1	-0.1	
2s	-0.1/0.2	0.05	
3s	0.2/0.4		
6s	0.4/0.6		
9s	0.6/0.8		
1y	0.7/0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.195	
2s	0.20/0.30		
3s	0.20/0.30		
6s	0.25/0.35	0.295	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐铠翊

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

