



【2024-11-05】

今天人民币兑美元中间价报 7.1016，较上一交易日调升 187 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 10.0/11.0，1m 成交 7.0/7.05/7.075/7.1/7.15，2m 成交 5.9，3m 成交 5.475/5.5，6m 成交 5.15/5.175/5.2，9m 成交 5.125，1y 成交 5.1。

RR 方面（25d），6m 成交 0.315。

BF 方面（25d），6m 成交 0.2725/0.2735，1y 成交 0.2725/0.275。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/05/2024		7.1016
ATM		187
		Traded
		Changes
1w	8.0/12.0	10.0/11.0
2w	7.0/11.0	
1s	5.0/8.0	7.0/7.05/7.075/7.1/7.15
2s	5.0/7.0	5.9
3s	5.0/6.0	5.475/5.5
6s	4.5/5.5	5.15/5.175/5.2
9s	4.5/5.5	5.125
1y	4.5/5.5	5.1
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	-0.3/0.1	
2s	-0.2/0.2	
3s	0/0.3	
6s	0.2/0.4	0.315
9s	0.3/0.5	
1y	0.4/0.6	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.1/0.25	
1s	0.20/0.30	
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.2725/0.2735
9s	0.25/0.35	
1y	0.25/0.35	0.2725/0.275