



【2024-12-03】

今天人民币兑美元中间价报 7.1996，较上一交易日调贬 131 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.8/5.0，2w 成交 4.6/4.7，3w 成交 4.7，1m 成交 4.8/5.0，2m 成交 5.35， 6m 成交 6.2，1y 成交 5.9/5.95/6.0/6.05/6.1/6.175/6.2/6.25/6.3。

BF 方面（25d），1w 成交 0.23，1m 成交 0.23，6m 成交 0.295，1y 成交 0.3。

RR 方面（25d），1m 成交 0.1，2m 成交 0.15。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	12/03/2024	7.1996
	ATM	Traded
		Changes
1w	4.0/6.0	4.8/5.0
2w	4.0/6.0	4.6/4.7
1s	4.0/6.0	4.7
2s	4.0/6.0	5.35
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	6.2
9s	5.0/7.0	
1y	5.0/7.0	5.9/5.95/6.0/6.05/6.1/6.175/6.2/6.25
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	0/0.5	0.1
2s	0/0.5	0.15
3s	0.2/0.6	
6s	0.4/0.8	0.65
9s	0.6/1.0	
1y	0.7/1.0	0.75
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	0.23
1s	0.10/0.30	0.23
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	0.3

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

Website: www.cfets-nex.com.cn

