



【2024-12-05】

今天人民币兑美元中间价报 7.1879，较上一交易日调升 55 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 5.0，1m 成交 4.5，3m 成交 5.35，6m 成交 5.975，1y 成交 6.025/6.05/6.075。

BF 方面（25d），1m 成交 0.23，6m 成交 0.3025/0.305，9m 成交 0.3025/0.305。

RR 方面（25d），1m 成交-0.3，3m 成交 0.2/0.25/0.3，6m 成交 0.55/0.6，9m 成交 0.65，1y 成交 0.725/0.74。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	12/05/2024	
	ATM	Traded
55 Changes		
1w	4.0/6.0	
2w	4.0/6.0	5.0
1s	4.0/6.0	4.5
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	5.35
6s	5.0/7.0	5.975
9s	5.0/7.0	
1y	5.0/7.0	6.025/6.05/6.075
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
25d RR		
	Traded	changes
1s	-0.5/0	-0.3
2s	-0.4/0.2	
3s	0.1/0.4	0.2/0.25/0.3
6s	0.4/0.8	0.55/0.6
9s	0.6/1.0	0.65
1y	0.7/1.0	0.725/0.74
25d FLY		
	Traded	changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	0.23
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.3025/0.305
9s	0.25/0.35	0.3025/0.305
1y	0.25/0.35	

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)

