



【2024-11-14】

今天人民币兑美元中间价报 7.1966，较上一交易日调升 25 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.35/4.4/4.45，2m 成交 4.6，3m 成交 4.8，6m 成交 5.0/5.025，9m 成交 5.05，1y 成交 5.1。

BF 方面（25d），1m 成交 0.175/0.18，6m 成交 0.26，9m 成交 0.26，1y 成交 0.26。

RR 方面（25d），1m 成交-0.4/-0.35，2m 成交-0.175，3m 成交 0.05，6m 成交 0.3，9m 成交 0.3875，1y 成交 0.5。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/14/2024	
	7.1966	-25
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	
2w	3.0/5.0	
1s	4.0/5.0	4.35/4.4/4.45
2s	4.0/5.0	4.6
3s	4.0/5.0	4.8
6s	4.5/5.5	5.0/5.025
9s	4.5/5.5	5.05
1y	4.5/5.5	5.1
2y	4.5/5.5	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.5/0	-0.4/-0.35
2s	-0.4/0	-0.2/-0.175
3s	0/0.2	0.05
6s	0.2/0.4	0.3
9s	0.3/0.5	0.3875
1y	0.4/0.6	0.5
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.1/0.2	
1s	0.10/0.20	0.175/0.18
2s	0.20/0.30	
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.26
9s	0.25/0.35	0.26
1y	0.25/0.35	0.26

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

