



【2024-12-19】

今天人民币兑美元中间价报 7.1911，较上一交易日调升 31 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.0/3.2，2w 成交 3.4, 1m 成交 4.3。

BF 方面（25d），2m 成交 0.28/0.2825, 9m 成交 0.2975。

RR 方面（25d），1m 成交-0.2, 2m 成交 0.15, 6m 成交 0.575。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	19/12/2024	7.1911
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	3.0/3.2
2w	3.0/5.0	3.4
1s	4.0/6.0	4.3
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	
9s	5.0/7.0	
1y	5.0/7.0	
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/0.2	-0.2
2s	-0.4/0.0	0.15
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	0.575
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.28/0.2825
3s	0.20/0.35	
6s	0.25/0.35	
9s	0.25/0.35	0.2975
1y	0.25/0.35	

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

