



【2024-12-30】

今天人民币兑美元中间价报 7.1889，较上一交易日调升 4 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.2，2w 成交 3.915，6m 成交 5.8，9m 成交 5.8，1y 成交 5.9。

RR 方面（25d）， 2w 成交-0.475/-0.5, 2m 成交 0.05。

BF 方面（25d）， 6m 成交 0.3，9m 成交 0.2975/0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	30/12/2024	7.1889	4
	ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.2	
2w	2.0/5.0	3.915	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0		
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.8	
9s	5.0/7.0	5.8	
1y	5.0/7.0	5.9	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/0.2		
2s	-0.2/0.2	0.05	
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7		
9s	0.6/0.75		
1y	0.65/0.8		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35	0.3	
9s	0.25/0.35	0.2975/0.3	
1y	0.25/0.35		

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

