



【2024-12-18】

今天人民币兑美元中间价报 7.1880，较上一交易日调贬 11 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.375，1m 成交 3.9/4.0, 2m 成交 5.025, 3m 成交 5.4/5.435, 6m 成交 5.78/5.8, 9m 成交 5.88, 1y 成交 5.91/5.925。

BF 方面（25d），1W 成交 0.21, 2W 成交 0.22, 2m 成交 0.2679，6m 成交 0.3/0.3025，9m 成交 0.3，1y 成交 0.3。

RR 方面（25d），6m 成交 0.55, 1y 成交 0.7。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	18/12/2024	7.1880
	ATM	Traded
		Changes
1w	3.0/5.0	3.375
2w	3.0/5.0	
1s	4.0/6.0	3.9/4.0
2s	4.0/6.0	5.025
3s	4.0/6.0	5.4/5.435
6s	5.0/7.0	5.78/5.8
9s	5.0/7.0	5.88
1y	5.0/7.0	5.91/5.925
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/-0.2	
2s	-0.4/0.0	
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	0.55
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	0.7
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	0.21
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.2679
3s	0.20/0.35	
6s	0.25/0.35	0.3/0.3025
9s	0.25/0.35	0.3
1y	0.25/0.35	0.3

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

