



【2024-11-22】

今天人民币兑美元中间价报 7.1942，较上一交易日调贬 8 个基点。

期权 ATM 方面， 3m 成交 4.825/4.9， 6m 成交 5.2/5.225， 9m 成交 5.25， 1y 成交 5.3。

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.245， 6m 成交 0.265， 9m 成交 0.266， 1y 成交 0.2675。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.55， 2m 成交-0.225， 3m 成交 0.15/0.175。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/22/2024		7.1942	8
ATM		Traded	Changes
1w	2.0/4.0		
2w	2.0/4.0		
1s	3.0/5.0		
2s	4.0/5.0		
3s	4.0/5.0	4.825/4.9	
6s	4.5/5.5	5.2/5.225	
9s	4.5/5.5	5.25	
1y	4.5/5.5	5.3	
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7/-0.2	-0.55	
2s	-0.4/0	-0.225	
3s	0.1/0.3	0.15/0.175/0.2	
6s	0.3/0.4		
9s	0.4/0.5		
1y	0.5/0.6		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.30	0.245	
3s	0.20/0.30		
6s	0.25/0.35	0.265	
9s	0.25/0.35	0.266	
1y	0.25/0.35	0.2675	