



【2024-12-06】

今天人民币兑美元中间价报 7.1848，较上一交易日调升 31 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.4/4.45，2m 成交 5.25，3m 成交 5.45，6m 成交 5.95，1y 成交 6.025/6.04/6.06。

BF 方面（25d），1m 成交 0.23/0.235/0.245，2m 成交 0.275，6m 成交 0.3025，9m 成交 0.3025/0.305，1y 成交 0.305。

RR 方面（25d），1m 成交-0.35，1y 成交 0.675。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	12/06/2024	
	7.1848	-31
	ATM	Traded
		Changes
1w	4.0/6.0	
2w	4.0/6.0	
1s	4.0/6.0	4.4/4.45
2s	4.0/6.0	5.25
3s	4.0/6.0	5.45
6s	5.0/7.0	5.95
9s	5.0/7.0	
1y	5.0/7.0	6.025/6.04/6.06
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.5/0	-0.35
2s	-0.4/0.2	
3s	0.1/0.4	
6s	0.4/0.7	
9s	0.5/0.7	
1y	0.6/0.8	0.675
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	0.23/0.235/0.245
2s	0.20/0.30	0.275
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.3025
9s	0.25/0.35	0.3025/0.305
1y	0.25/0.35	0.305

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

