



【2024-11-19】

今天人民币兑美元中间价报 7.1911，较上一交易日调贬 4 个基点。

期权 ATM 方面， 1m 成交 4.15/4.175/4.2， 2m 成交 4.35/4.4/4.45， 3m 成交 4.675/4.685/4.7， 9m 成交 5.15。

BF 方面（25d）， 3w 成交 0.195， 1m 成交 0.19， 6m 成交 0.2625， 1y 成交 0.2635。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.5， 6m 成交 0.35。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/19/2024		7.1911	4
ATM		Traded	Changes
1w	2.0/4.0		
2w	2.0/4.0		
1s	3.0/5.0	4.15/4.175/4.2	
2s	4.0/5.0	4.35/4.4/4.45	
3s	4.0/5.0	4.675/4.685/4.7	
6s	4.5/5.5		
9s	4.5/5.5	5.15	
1y	4.5/5.5		
2y	4.5/5.5		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.7/-0.2	-0.5	
2s	-0.4/0		
3s	-0.1/0.1		
6s	0.2/0.4	0.35	
9s	0.3/0.5		
1y	0.4/0.6		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.19	
2s	0.20/0.30		
3s	0.20/0.30		
6s	0.25/0.35	0.2625	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35	0.2635	