



【2024-11-28】

今天人民币兑美元中间价报 7.1894，较上一交易日调升 88 个基点。

期权 ATM 方面， 1m 成交 4.0/4.075， 2m 成交 4.9， 3m 成交 5.15/5.2/5.25/5.325， 6m 成交 5.55/5.575/5.6/5.65/5.7， 9m 成交 5.65/5.7， 1y 成交 5.7/5.75。

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.25， 6m 成交 0.285/0.2875/0.29， 9m 成交 0.285/0.29， 1y 成交 0.29

RR 方面（25d）， 6m 成交 0.55/0.575， 9m 成交 0.675。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	11/28/2024	
	7.1894	88
	ATM	Traded
		Changes
1w	2.0/4.0	
2w	2.0/4.0	
1s	3.0/5.0	4.0/4.075
2s	4.0/6.0	4.9
3s	4.0/6.0	5.15/5.2/5.25/5.325
6s	5.0/6.0	5.55/5.575/5.6/5.65/5.7
9s	5.0/6.0	5.65/5.7
1y	5.0/6.0	5.7/5.75
2y	5.0/6.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.7/0.0	
2s	-0.4/0.2	
3s	0.2/0.4	
6s	0.4/0.6	0.55/0.575
9s	0.6/0.8	0.675
1y	0.7/0.8	
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.30	0.25
3s	0.20/0.30	
6s	0.25/0.35	0.285/0.2875/0.29
9s	0.25/0.35	0.285/0.29
1y	0.25/0.35	0.29

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

