



【2025-01-08】

今天人民币兑美元中间价报 7.1887，较上一交易日调贬 8 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.5/3.6，1m 成交 4.7，2m 成交 5.0/5.05，6m 成交 5.6，9m 成交 5.6/5.625/5.65，1y 成交 5.635/5.65/5.66/5.675/5.75。

RR 方面（25d），1m 成交-0.2，3m 成交 0.2，9m 成交 0.775，1y 成交 0.8。

BF 方面（25d），1m 成交 0.265，3m 成交 0.28，6m 成交 0.285/0.2875/0.29，9m 成交 0.285/0.29，1y 成交 0.295。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
01/07/2025		7.1879	3
ATM		Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.5/3.6	
2w	2.0/5.0		
1s	4.0/6.0	4.7	
2s	4.0/6.0	5.0/5.05	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.6	
9s	5.0/7.0	5.6/5.625/5.65	
1y	5.0/7.0	5.635/5.65/5.66/5.675/5.75	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.2/0.2	-0.2	
2s	0.0/0.4		
3s	0.0/0.4	0.2	
6s	0.4/0.7		
9s	0.6/0.8	0.775	
1y	0.65/0.85	0.8	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35	0.27/0.2725/0.28	
3s	0.20/0.35	0.27	
6s	0.25/0.35	0.275/0.2775	
9s	0.25/0.35	0.275/0.2775	
1y	0.25/0.35	0.2775	