

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS NEX International Money Broker

【2025-01-03】

今天人民币兑美元中间价报 7.1878，较上一交易日调升 1 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.35/3.4/3.5，1m 成交 4.3/4.4，2m 成交 5.0，6m 成交 5.525/5.8/5.825，1y 成交 5.875。

RR 方面 (25d)，1w 成交 0.3，1m 成交 0.1，2m 成交 0.3，6m 成交 0.55/0.6，1y 成交 0.75。

BF 方面 (25d)，6m 成交 0.2925/0.295，1y 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	01/03/2025	7.1878	1
	ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.35/3.4/3.5	
2w	2.0/5.0		
1s	4.0/6.0	4.3/4.4	
2s	4.0/6.0	5.0	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.525/5.8/5.825	
9s	5.0/7.0		
1y	5.0/7.0	5.875	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	0.0/0.2	0.1	
2s	0.0/0.4	0.3	
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7	0.55/0.6	
9s	0.6/0.8		
1y	0.65/0.85	0.75	
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35	0.2925/0.295	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35	0.3	

Thanks & Best Regards

姓名 **Bill** 唐锐翊

外汇期权 **FX option**