



【2025-01-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.1889，较上一交易日调升 8 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 4.6/4.65/4.85，1m 成交 5.0，6m 成交 5.62/5.625/5.63，9m 成交 5.7，1y 成交 5.75/5.765。

RR 方面（25d），2w 成交-0.035，1m 成交 0.11，3m 成交 0.325，6m 成交 0.625/0.65，9m 成交 0.875，1y 成交 0.875。

BF 方面（25d），2w 成交 0.275。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
01/17/2025	7.1889	9
ATM	Traded	Changes
1w	3.0/5.0	
2w	3.0/5.0	4.6/4.65/4.85
1s	4.0/6.0	5.0
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	
6s	5.0/7.0	5.62/5.625/5.63
9s	5.0/7.0	5.7
1y	5.0/7.0	5.75/5.765
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	

	25d RR	Traded	changes
1s	-0.1/0.2	0.11	
2s	0.1/0.4		
3s	0.2/0.5	0.325	
6s	0.5/0.7	0.625/0.65	
9s	0.6/0.9	0.875	
1y	0.7/0.9	0.875	
	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		
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		

Thanks & Best Regards

姓名 **Bill 唐铠翊**

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)