



【2025-01-15】

今天人民币兑美元中间价报 7.1883，较上一交易日调贬 5 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.6/3.7/3.8，2w 成交 4.1/4.175/4.2/4.3/4.4，2m 成交 5.05/5.075，3m 成交 5.4，6m 成交 5.6/5.625，9m 成交 5.705。

RR 方面（25d），3m 成交 0.25，6m 成交 0.575/0.6，9m 成交 0.8，1y 成交 0.85。

BF 方面（25d），2m 成交 0.275。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	01/15/2025	7.1883	5
	ATM	Traded	Changes
1w	3.0/5.0	3.6/3.7/3.8	
2w	3.0/5.0	4.1/4.175/4.2/4.3/4.4	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.05/5.075	
3s	4.0/6.0	5.4	
6s	5.0/7.0	5.6/5.625	
9s	5.0/7.0	5.705	
1y	5.0/7.0		
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		

	25d RR	Traded	changes
1s	-0.1/0.1		
2s	0.0/0.3		
3s	0.0/0.4	0.25	
6s	0.4/0.7	0.575/0.6	
9s	0.6/0.9	0.8	
1y	0.7/0.9	0.85	
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35	0.275	
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

Website: www.cfets-nex.com.cn

