



【2025-01-02】

今天人民币兑美元中间价报 7.1879，较上一交易日调升 5 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.6/3.7， 3m 成交 5.4， 6m 成交 5.5125/5.525/5.535/5.55/5.6， 9m 成交 5.675， 1y 成交 5.6625/5.675/5.7/5.75。

RR 方面（25d）， 1m 成交-0.25/-0.2， 6m 成交 0.55， 1y 成交 0.75。

BF 方面（25d）， 2m 成交 0.2875， 3m 成交 0.285/0.2875/0.29， 6m 成交 0.3/0.3025， 9m 成交 0.305。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
	01/02/2025	7.1879
	ATM	Traded
		Changes
1w	2.0/4.0	3.6/3.7
2w	2.0/5.0	
1s	4.0/6.0	
2s	4.0/6.0	
3s	4.0/6.0	5.4
6s	5.0/7.0	5.5125/5.525/5.535/5.55/5.6
9s	5.0/7.0	5.675
1y	5.0/7.0	5.6625/5.675/5.7/5.75
2y	5.0/7.0	
3y	4.5/5.5	
	25d RR	Traded
		changes
1s	-0.8/0.2	-0.25/-0.2
2s	-0.2/0.2	
3s	0.0/0.4	
6s	0.4/0.7	0.55
9s	0.6/0.75	
1y	0.65/0.8	0.75
	25d FLY	Traded
		changes
1w	0.10/0.30	
1s	0.10/0.30	
2s	0.20/0.35	0.2875
3s	0.20/0.35	0.285/0.2875/0.29
6s	0.25/0.35	0.3/0.3025
9s	0.25/0.35	0.305
1y	0.25/0.35	0.3

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐锐翊

外汇期权 FX option

