



【2025-01-07】

今天人民币兑美元中间价报 7.1879，较上一交易日调贬 3 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.6/3.8/4.0，2w 成交 4.0/4.1，2m 成交 5.1，6m 成交 5.71/5.725，9m 成交 5.725/5.75，1y 成交 5.75/5.785/5.8。

RR 方面（25d），1w 成交-0.15/-0.05，1m 成交-0.1/-0.05，2m 成交 0.15，3m 成交 0.275/0.3/0.325，6m 成交 0.625，9m 成交 0.75/0.775，1y 成交 0.8125。

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	3.6/3.8/4.0	
2w	2.0/5.0	4.0/4.1	
1s	4.0/6.0		
2s	4.0/6.0	5.1	
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.71/5.725	
9s	5.0/7.0	5.725/5.75	
1y	5.0/7.0	5.75/5.785/5.8	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.2/0.2	-0.1/-0.05	
2s	0.0/0.4	0.15	
3s	0.0/0.4	0.275/0.3/0.325	
6s	0.4/0.7	0.625	
9s	0.6/0.8	0.75/0.775	
1y	0.65/0.85	0.8125	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.265	
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35	0.28	
6s	0.25/0.35	0.285/0.2875/0.29	
9s	0.25/0.35	0.285/0.29	
1y	0.25/0.35	0.2925	