



【2025-01-14】

今天人民币兑美元中间价报 7.1878，较上一交易日调升 7 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.7/3.8/3.9，2w 成交 4.4，1m 成交 4.55，2m 成交 5.05，3m 成交 5.4，6m 成交 5.6/5.6125，9m 成交 5.675/5.6975，1y 成交 5.725/5.7475/5.75。

RR 方面（25d），1m 成交 0/0.05，6m 成交 0.6，9m 成交 0.8/0.825/0.85，1y 成交 0.85。

BF 方面（25d），2m 成交 0.27，9m 成交 0.2775/0.28，1y 成交 0.28。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
01/14/2025		7.1878	7
ATM		Traded	Changes
1w	3.0/5.0	3.7/3.8/3.9	
2w	3.0/5.0	4.4	
1s	4.0/6.0	4.55	
2s	4.0/6.0	5.05	
3s	4.0/6.0	5.4	
6s	5.0/7.0	5.6/5.6125	
9s	5.0/7.0	5.675/5.6975	
1y	5.0/7.0	5.725/5.7475/5.75	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		

	25d RR	Traded	changes
1s	-0.1/0.1	0/0.05	
2s	0.0/0.3		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7	0.6	
9s	0.6/0.9	0.8/0.825/0.85	
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	0.27	
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.2775/0.28	
1y	0.25/0.35	0.28	

Thanks & Best Regards

