



【2025-05-09】

今天人民币兑美元中间价报 7.2095，较上一交易日调贬 22 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.3/4.4，2w 成交 4.4，1m 成交 4.325/4.35，2m 成交 4.375/4.4/4.45，3m 成交 4.45/4.475，9m 成交 4.75，1y 成交 4.875。

BF 方面（25d），1m 成交 0.225/0.23，3m 成交 0.245，1y 成交 0.29。

RR 方面（25d），1w 成交-0.4，1m 成交-0.2/-0.175，2m 成交-0.075，3m 成交 0.1/0.125。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |                |         |
|---------------------------|----------------|---------|
| 05/09/2025                | 7.2095         | 22      |
| ATM                       | Traded         | Changes |
| 1w 3.0/6.0                | 4.3/4.4        |         |
| 2w 3.0/6.0                | 4.4            |         |
| 1s 4.0/6.0                | 4.325/4.35     |         |
| 2s 4.0/7.0                | 4.375/4.4/4.45 |         |
| 3s 4.0/7.0                | 4.45/4.475     |         |
| 6s 4.0/7.0                |                |         |
| 9s 4.0/7.0                | 4.75           |         |
| 1y 4.0/7.0                | 4.875          |         |
| 2y 5.0/6.0                |                |         |
| 3y 5.0/6.5                |                |         |
| 25d RR                    | Traded         | changes |
| 1s -0.5/0.1               | -0.2/-0.175    |         |
| 2s -0.4/0.2               | -0.075         |         |
| 3s 0.0/0.3                | 0.1/0.125      |         |
| 6s 0.4/1.0                |                |         |
| 9s 0.5/1.0                |                |         |
| 1y 0.6/1.0                |                |         |
| 25d FLY                   | Traded         | changes |
| 1w 0.10/0.35              |                |         |
| 1s 0.10/0.35              | 0.225/0.23     |         |
| 2s 0.20/0.35              |                |         |
| 3s 0.20/0.35              | 0.245          |         |
| 6s 0.20/0.45              |                |         |
| 9s 0.20/0.45              |                |         |
| 1y 0.20/0.45              | 0.29           |         |

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)

Phone: 86-21-38617888 | Mobile: 86-13611111111 | Fax: 86-21-50472092 | Email: [XXXX.XXXX@cfets-nex.com.cn](mailto:XXXX.XXXX@cfets-nex.com.cn)

Website: [www.cfets-nex.com.cn](http://www.cfets-nex.com.cn)

