

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2025-01-20】

今天人民币兑美元中间价报 7.1886，较上一交易日调升 3 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 5.7/5.85/5.9，1m 成交 5.375/5.425，2m 成交 5.5，3m 成交 5.575/5.6/5.625，6m 成交 5.675/5.7，9m 成交 5.725/5.75，1y 成交 5.775。

RR 方面（25d），3m 成交 0.35，6m 成交 0.625。

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

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
01/20/2025		7.1886	3
ATM		Traded	Changes
1w	3.0/5.0		
2w	4.0/6.0	5.7/5.85/5.9	
1s	4.0/6.0	5.375/5.425	
2s	4.0/6.0	5.5	
3s	4.0/6.0	5.575/5.6/5.625	
6s	5.0/7.0	5.675/5.7	
9s	5.0/7.0	5.725/5.75	
1y	5.0/7.0	5.775	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR		Traded	changes
1s	-0.1/0.2		
2s	0.1/0.4		
3s	0.2/0.5	0.35	

6s	0.5/0.7	0.625	
9s	0.6/0.9		
1y	0.7/0.9		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30	0.27	
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.28	
1y	0.25/0.35	0.28	

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)

