



【2025-12-24】

今天人民币兑美元中间价报 7.0471，较上一交易日调升 52 个基点。

期权 ATM 方面，整体成交水平较昨日大幅上升，1m 成交 2.3，3m 成交 2.6/2.7，6m 成交 2.99/3.0/3.025/3.075，9m 成交 3.3/3.35/3.4，1y 成交 3.5/3.525/3.575。
BF 方面（25d），整体成交水平较昨日小幅上升，1m 成交 0.2125/0.215，2m 成交 0.225，3m 成交 0.233，6m 成交 0.251，9m 成交 0.2525，1y 成交 0.255。
RR 方面（25d），成交较少但整体波动率区间向下，3m 成交-0.85。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
12/24/2025		7.0471	+52
	ATM	Traded	Changes
1w	1.0/4.0		
2w	1.0/4.0		
1s	1.0/4.0	2.3	
2s	1.0/4.0		
3s	2.0/4.0	2.6/2.7	
6s	2.0/4.0	2.99/3.0/3.025/3.075	
9s	2.0/5.0	3.3/3.35/3.4	
1y	2.0/5.0	3.5/3.525/3.575	
2y	2.0/5.0		
3y	2.0/5.0		
25d RR		Traded	changes
1s	-1.2/0.0		
2s	-1.1/0.0		
3s	-1.0/0.0	-0.85	
6s	-1.0/0.0		
9s	-0.8/0.0		
1y	-0.8/0.0		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.05/0.2		
1s	0.10/0.3	0.2125/0.215	
2s	0.20/0.3	0.225	
3s	0.20/0.3	0.233	
6s	0.20/0.4	0.251	
9s	0.20/0.4	0.2525	
1y	0.20/0.4	0.255	

免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，信息不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。