

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

【2025-01-16】

今天人民币兑美元中间价报 7.1881，较上一交易日调升 2 个基点。

期权 ATM 方面，3w 成交 4.4/4.55/4.6/4.65，1m 成交 4.65，2m 成交 5.1，3m 成交 5.41，6m 成交 5.6/5.61/5.615，9m 成交 5.68/5.685，1y 成交 5.75。

RR 方面（25d），6m 成交 0.625。

BF 方面（25d），2m 成交 0.2775，3m 成交 0.2775，6m 成交 0.2775。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
01/16/2025		7.1881	2
ATM		Traded	Changes
1w	3.0/5.0		
2w	3.0/5.0		
1s	4.0/6.0	4.65	
2s	4.0/6.0	5.1	
3s	4.0/6.0	5.41	
6s	5.0/7.0	5.6/5.61/5.615	
9s	5.0/7.0	5.68/5.685	
1y	5.0/7.0	5.75	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		

	25d RR	Traded	changes
1s	-0.1/0.1		
2s	0.0/0.3		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7	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		
2s	0.20/0.35	0.2775	
3s	0.20/0.35	0.2775	
6s	0.25/0.35	0.2775	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35		

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐铠翊
外汇期权 FX option

