

# 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 Broker

**【2025-01-06】**

今天人民币兑美元中间价报 7.1876，较上一交易日调升 2 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.5/3.6，2w 成交 3.8，1m 成交 4.7，2m 成交 5.3，3m 成交 5.5，6m 成交 5.775/5.78，9m 成交 5.8/5.825，1y 成交 5.85/5.8575。

RR 方面 (25d)，1w 成交-0.03/-0.025，1m 成交 0，9m 成交 0.775。

BF 方面 (25d)，3m 成交 0.2825/0.285/0.29，6m 成交 0.295/0.3，1y 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	01/06/2025	7.1876	2
	ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.5/3.6	
2w	2.0/5.0	3.8	
1s	4.0/6.0	4.7	
2s	4.0/6.0	5.3	
3s	4.0/6.0	5.5	
6s	5.0/7.0	5.775/5.78	
9s	5.0/7.0	5.8/5.825	
1y	5.0/7.0	5.85/5.8575	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
25d RR			
		Traded	changes
1s	0.0/0.2	0.0	
2s	0.0/0.4		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7		
9s	0.6/0.8	0.775	
1y	0.65/0.85		
25d FLY			
		Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35	0.2825/0.285/0.29	
6s	0.25/0.35	0.295/0.3	
9s	0.25/0.35		
1y	0.25/0.35	0.3	