

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

【2025-06-30】

今天人民币兑美元中间价报 7.1586，较上一交易日调升 41 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 3.3/3.375/3.45，1m 成交 3.4/3.425，2m 成交 3.625，3m 成交 3.8，6m 成交 4.125，9m 成交 4.2，1y 成交 4.325。

RR 方面（25d），9m 成交 0.45。

BF 方面（25d），1m 成交 0.225，6m 成交 0.26。

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP | | |
|---------------------------|----------------|---------|
| 06/30/2025 | 7.1586 | 41 |
| ATM | Traded | Changes |
| 1w 2.0/4.0 | 3.3/3.375/3.45 | |
| 2w 2.0/4.0 | | |
| 1s 3.0/6.0 | 3.4/3.425 | |
| 2s 3.0/6.0 | 3.625 | |
| 3s 3.0/6.0 | 3.8 | |
| 6s 3.0/6.0 | 4.125 | |
| 9s 4.0/6.0 | 4.2 | |
| 1y 4.0/6.0 | 4.325 | |
| 2y 4.0/6.0 | | |
| 3y 3.0/6.5 | | |
| 25d RR | Traded | changes |
| 1s -0.5/0.0 | | |
| 2s -0.4/0.0 | | |
| 3s -0.3/0.0 | | |
| 6s 0.2/0.6 | | |
| 9s 0.3/0.7 | 0.45 | |
| 1y 0.5/1.0 | | |
| 25d FLY | Traded | changes |
| 1w 0.10/0.3 | | |
| 1s 0.10/0.3 | 0.225 | |
| 2s 0.20/0.3 | | |
| 3s 0.20/0.3 | | |
| 6s 0.20/0.4 | 0.26 | |
| 9s 0.20/0.4 | | |
| 1y 0.20/0.4 | | |

Thanks & Best Regards

姓名 Bill 唐铠翊

外汇期权 FX option

