

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-8-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.2076，较上一交易日上调 90 个基点。

期权 ATM 方面， 2w 成交 6.4， 1m 成交 6.0， 3m 成交 5.55， 9m 成交 5.35， 1y 成交 5.35/5.4

RR 方面（25d）， 1w 成交 0.25， 1m 成交 0.325

FLY 方面（25d）， 1m 成交 0.19， 3m 成交 0.215/0.22

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/17/2023	7.2076	+90
ATM	Traded	Changes
1w	5.0 / 7.0	
2w	5.0 / 7.0	6.4
1s	5.5 / 6.5	6.0
2s	5.0 / 5.8	
3s	5.0 / 5.8	5.55
6s	4.5 / 5.5	
9s	4.5 / 5.5	5.35
1y	4.5 / 5.5	5.35/5.4
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR	Traded	changes
1s	0.1 / 0.4	0.325
2s	0.1 / 0.4	
3s	0.2 / 0.4	
6s	0.3 / 0.6	
9s	0.3 / 0.6	
1y	0.3 / 0.6	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.15 / 0.3	
1s	0.15 / 0.3	0.19
2s	0.15 / 0.3	
3s	0.15 / 0.3	0.215/0.22
6s	0.15 / 0.3	
9s	0.15 / 0.3	
1y	0.15 / 0.3	

Daisy Dai

联系人: Rafoel Wang
邮箱: rafoel.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“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。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN