

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-7-27】

今天人民币兑美元中间价报 7.1265，较上一交易日下调 30 个基点。

期权 ATM 方面， 1w 成交 5.8/5.9， 1m 成交,4.95， 6m 成交 4.675/4.7， ， 9m 成交 4,73， 1y 成交 4.7/4.725/4.75

FLY 方面（25d）， 3m 成交 0.2

Vanilla 方面，今天短期成交比较多， on 7.16 usd call 成交 10pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
7/27/2023	7.1265	-30
ATM	Traded	Changes
1w 5.0 / 7.0	5.8/5.9	
2w 5.0 / 6.5		
1s 4.8 / 5.8	4.95	
2s 4.5 / 5.5		
3s 4.5 / 5.5		
6s 4.3 / 5.0	4.675/4.7	
9s 4.3 / 5.0	4.73	
1y 4.3 / 5.0	4.7/4.725/4.75	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0 / 0.4		
2s 0.1 / 0.4		
3s 0.2 / 0.4		
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5		
1y 0.2 / 0.5		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.15 / 0.3		
1s 0.15 / 0.3		
2s 0.15 / 0.3		
3s 0.15 / 0.3	0.2	
6s 0.15 / 0.3		
9s 0.15 / 0.3		
1y 0.15 / 0.3		

文 / Ben Qian

联系人：Rafael Wang
邮箱：rafael.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：

以上所登及附加的所有信息（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