

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-7-19】

今天人民币兑美元中间价报 7.1486，较上一交易日调升 33 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.4/5.5，2w 成交 5.5/5.525，1m 成交 4.9/5.1，2m 成交 4.8125，3m 成交 4.75/4.85，6m 成交 4.75/4.775，9m 成交 4.8，1y 成交 4.8/4.825

RR 方面（25d），6m/9m/1y 成交 0.35

FLY 方面（25d），3w 成交 0.2，3m 成交 0.19

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
7/19/2023	7.1486	33
ATM	Traded	Changes
1w 4.8 / 6.0	5.4/5.5	
2w 4.8 / 6.0	5.5/5.525	
1s 4.5 / 5.5	4.9/5.1	
2s 4.0 / 5.0	4.8125	
3s 4.0 / 5.0	4.75/4.85	
6s 4.3 / 5.0	4.75/4.775	
9s 4.3 / 5.0	4.8	
1y 4.3 / 5.0	4.8/4.825	
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 / 0.4	0.35	
9s 0.2 / 0.4	0.35	
1y 0.2 / 0.4	0.35	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.15 / 0.3		
1s 0.15 / 0.3		
2s 0.15 / 0.3		
3s 0.15 / 0.3	0.19	
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