

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-8-8】

今天人民币兑美元中间价报 7.1565，较上一交易日调贬 185 个基点。

期权 ATM 方面，on 成交 70pips，1w 成交 5.4，3m 成交 4.81，6m 成交 4.75~4.78 区间，9m 成交 4.77 和 4.8，1y 成交 4.8

FLY 方面（25d），1m 成交 0.1725，9m 成交 0.28，1y 成交 0.2825

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/8/2023		7.1565
ATM		+185
		Traded
		Changes
1w	5.0 / 6.0	5.4
2w	5.0 / 6.0	
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.5 / 5.5	
3s	4.5 / 5.5	4.81
6s	4.3 / 5.0	4.75~4.78
9s	4.3 / 5.0	4.77, 4.8
1y	4.3 / 5.0	4.8
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	0.1725
2s	0.15 / 0.3	
3s	0.15 / 0.3	
6s	0.15 / 0.3	
9s	0.15 / 0.3	0.28
1y	0.15 / 0.3	0.2825

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