

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-4-11】

今天人民币兑美元中间价报 6.8882，较上一交易日下调 118 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.0，1m 成交 5.35，2m 成交 5.25 和 5.2，3m 成交 5.15 和 5.125，另有 1*3m sprd 成交-0.25

RR 方面（25d），1w 成交 0.4，1m 和 3m 均成交 0.375

FLY 方面（25d），2m 成交 0.235，3m 成交 0.23，6m 成交 0.24、0.2425 和 0.241

Vanilla 方面，on 6.8750 put 成交 55pips，1w 6.85 put 成交 77 和 75pips，1y 7.3 call 成交 160pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
4/11/2023		6.8882
		+118
ATM		Traded
		Changes
1w	4.5 / 6.0	5.0
2w	4.5 / 6.0	
1s	5.0 / 5.8	5.35
2s	5.0 / 5.5	5.25, 5.2
3s	5.0 / 5.5	5.15, 5.125
6s	4.7 / 5.5	
9s	4.6 / 5.3	
1y	4.5 / 5.2	
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	0.3 / 0.8	0.375
2s	0.3 / 0.8	
3s	0.3 / 0.9	0.375
6s	0.5 / 1.0	
9s	0.5 / 1.1	
1y	0.5 / 1.1	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.2 / 0.5	
1s	0.2 / 0.5	
2s	0.2 / 0.5	0.235
3s	0.2 / 0.5	0.23
6s	0.2 / 0.5	0.24, 0.2425, 0.241
9s	0.2 / 0.5	
1y	0.2 / 0.5	

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