

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-8-4】

今天人民币兑美元中间价报 7.1418，较上一交易日下调 77 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.6/6.0， 2m 成交 4.925/4.95， 3m 成交 4.825/4.85， 6m 成交 4.775， 1y 成交 4.8

RR 方面（25d）， 9m 成交 0.325

FLY 方面（25d）， 1m 成交 0.17， 2m 成交 0.185， 3m 成交 0.195， 9m 成交 0.28

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/4/2023		7.1418
		-77
ATM		Traded
		Changes
1w	4.5 / 6.0	5.6/6.0
2w	5.0 / 6.0	
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.5 / 5.5	4.925/4.95
3s	4.5 / 5.5	4.825/4.85
6s	4.3 / 5.0	4.775
9s	4.3 / 5.0	
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	0.325
1y	0.2 / 0.5	
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.15 / 0.3	
1s	0.15 / 0.3	0.17
2s	0.15 / 0.3	0.185
3s	0.15 / 0.3	0.195
6s	0.15 / 0.3	
9s	0.15 / 0.3	0.28
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