

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-3-30】

今天美元兑人民币中间价报 6.8886，较上一交易日上调 115 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.0/6.4，2w 成交 6.4/6.8，3m 成交 5.475/5.5，9m 成交 5.0，1y 成交 4.925

RR 方面（25d），3m 成交 0.6

FLY 方面（25d），3m 成交 0.225，9m 成交 0.25

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
3/30/2023	6.8886	115
ATM	Traded	Changes
1w 6.0 / 9.0	6.0/6.4	
2w 6.0 / 9.0	6.4/6.8	
1s 5.0 / 6.0		
2s 5.0 / 6.0		
3s 5.0 / 6.0	5.475/5.5	
6s 4.7 / 5.5		
9s 4.6 / 5.3	5.0	
1y 4.5 / 5.2	4.925	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.3 / 0.8		
2s 0.3 / 0.8		
3s 0.4 / 0.9	0.6	
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		
3s 0.2 / 0.5	0.225	
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5	0.25	
1y 0.2 / 0.5		

文 / Daisy dai

联系人：Rafael Wong
邮箱：rafael.wong@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：

以上所提及附加的所有信息（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