

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列

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

【2023-4-19】

今天美元兑人民币中间价报 6.8731，较上一交易日下调 83 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.3/4.4/4.5，1m 成交 4.9，2m/3m 成交 4.9，6m 成交 4.87/4.89，1y 成交 4.79/4.8

RR 方面 (25d)，1m 成交 0.3，2m 成交 0.35，3m 成交 0.5，6m 成交 0.5/0.55

FLY 方面 (25d)，1w 成交 0.275

Vanilla 方面，1w 6.9 usd call trd 75/80pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	4/19/2023	6.8731	-83
	ATM	Traded	Changes
1w	3.5 / 5.0	4.3/4.4/4.5	
2w	3.5 / 5.0		
1s	4.0 / 5.5	4.9	
2s	4.5 / 5.5	4.9	
3s	4.5 / 5.5	4.9	
6s	4.5 / 5.5	4.87/4.89	
9s	4.6 / 5.3		
1y	4.5 / 5.2	4.79/4.8	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	0.3 / 0.8	0.3	
2s	0.3 / 0.8	0.35	
3s	0.3 / 0.8	0.5	
6s	0.5 / 1.0	0.5/0.55	
9s	0.5 / 1.1		
1y	0.5 / 1.1		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.2 / 0.5	0.275	
1s	0.2 / 0.5		
2s	0.2 / 0.5		
3s	0.2 / 0.5		
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5		

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafaol.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:

以上所念及附加的所有信息(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