

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-7-17】

今天人民币兑美元中间价报 7.1326，较上一交易日调升 8 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.85，1m 成交 4.825/4.85， 1y 成交 4.625

RR 方面（25d）， 3w 成交 0.05/0.075， 6m 成交在 0.3， 1y 成交 0.31

FLY 方面（25d）,1w 成交 0.25， 1m/2m 成交 0.18

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
7/17/2023	7.1326	8
ATM	Traded	Changes
1w 4.0 / 5.5	4.85	
2w 4.0 / 5.5		
1s 4.0 / 5.0	4.825/4.85	
2s 4.0 / 5.0		
3s 4.0 / 5.0		
6s 4.3 / 5.0		
9s 4.3 / 5.0		
1y 4.3 / 5.0	4.625	
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 / 0.4	0.3	
9s 0.2 / 0.4		
1y 0.2 / 0.4	0.31	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.15 / 0.3	0.25	
1s 0.15 / 0.3	0.18	
2s 0.15 / 0.3	0.18	
3s 0.15 / 0.3		
6s 0.15 / 0.3		
9s 0.15 / 0.3		
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