

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-3-28】

今天人民币兑美元中间价报 6.8749，较上一交易日下调 35 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.45，3m 成交 5.525，6m 成交 5.15，另有 9*1y 成交-0.1。

FLY 方面（25d），2m 成交 0.22 和 0.225，8m 成交 0.25，9m 成交 0.25 和 0.255，1y 成交 0.25 和 0.255

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
3/28/2023	6.8749	+35
ATM	Traded	Changes
1w 6.0 / 8.0	6.45	
2w 6.0 / 8.0		
1s 5.0 / 7.0		
2s 5.0 / 6.5		
3s 5.0 / 6.0	5.525	
6s 4.7 / 5.5	5.15	
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		
2s 0.3 / 0.8		
3s 0.4 / 0.9		
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	0.22, 0.225	
3s 0.2 / 0.5		
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5	0.25, 0.255	
1y 0.2 / 0.5	0.25, 0.255	

文 / Daisy dai

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