

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-2-14】

今天人民币兑美元中间价报 6.8136，较上一交易日上调 15 个基点。

期权 ATM 方面今日成交较为寡淡，2/24 到期的 ATM 成交 6.2，另有 3*1y atm 成交-0.57

FLY 方面（25d），1m 成交 0.25 和 0.255，2m 成交 0.25，3m 成交 0.245。市场另有 2w 10d fly 成交在 0.61 和 0.6

Vanilla 方面，1w 6.85 call 成交 115pips，6m 6.9 call 成交 410 和 415pips，1w 6.77 put 成交 95、90pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
2/14/2023	6.8136	-15
ATM	Traded	Changes
1w	5.5 / 7.0	
2w	5.5 / 7.0	
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.8 / 5.5	
3s	4.8 / 5.8	
6s	4.3 / 5.3	
9s	4.3 / 5.0	
1y	4.3 / 5.0	
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR	Traded	changes
1s	0.2 / 0.8	
2s	0.2 / 0.8	
3s	0.3 / 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	0.25, 0.255
2s	0.2 / 0.5	0.25
3s	0.2 / 0.5	0.245
6s	0.2 / 0.5	
9s	0.2 / 0.5	
1y	0.2 / 0.5	

文 / Ben Qian

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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息