

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-2-27】

今天美元兑人民币中间价报 6.9572，较上一交易日上调 630 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 5.5/5.6，3m 成交 5.4/5.425，9m 成交 5.0/5.025，1y 成交 4.95/4.975

RR 方面（25d），2w 成交 0.9/1.0，1m 成交 0.9

FLY 方面（25d），2m 成交 0.24/0.25，6m 成交 0.26

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	2/27/2023	6.9572	630
	ATM	Traded	Changes
1w	5.0 / 6.5		
2w	5.0 / 6.5		
1s	5.0 / 6.0		
2s	4.8 / 5.8	5.5/5.6	
3s	4.8 / 5.8	5.4/5.425	
6s	4.3 / 5.3		
9s	4.3 / 5.0	5.0/5.025	
1y	4.3 / 5.0	4.95/4.975	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	0.9	
2s	0.5 / 1.0		
3s	0.5 / 1.0		
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	0.24/0.25	
3s	0.2 / 0.5		
6s	0.2 / 0.5	0.26	
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5		

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