

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-7-21】

今天人民币兑美元中间价报 7.1456，较上一交易日下调 10 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.8/6.0/6.2，2w 成交 5.3，1m 成交 5.2/5.275/5.3，2m 成交 5.0，3m 成交 4.9/4.925，6m 成交 4.8/4.825，1y 成交 4.85/4.875

FLY 方面（25d），1w/2w 成交 0.225，1y 成交 0.2825

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
7/21/2023	7.1456	-10
ATM	Traded	Changes
1w	4.8 / 6.0	5.8/6.0/6.2
2w	4.8 / 6.0	5.3
1s	4.5 / 5.5	5.2/5.275/5.3
2s	4.0 / 5.0	5.0
3s	4.0 / 5.0	4.9/4.925
6s	4.3 / 5.0	4.8/4.825
9s	4.3 / 5.0	
1y	4.3 / 5.0	4.85/4.875
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	
9s	0.2 / 0.4	
1y	0.2 / 0.4	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.15 / 0.3	0.225
1s	0.15 / 0.3	
2s	0.15 / 0.3	
3s	0.15 / 0.3	
6s	0.15 / 0.3	
9s	0.15 / 0.3	
1y	0.15 / 0.3	0.2825

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