

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2023-3-20】

今天美元兑人民币中间价报 6.8694，较上一交易日下调 358 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 5.8，3m 成交 5.525/5.55，1y 成交 4.925/4.95

RR 方面 (25d)，1m 成交 0.6/0.625，2m 成交 0.6，3m 成交 0.625

FLY 方面 (25d)，3m 成交 0.23

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
3/20/2023		6.8694	-358
ATM		Traded	Changes
1w	6.0 / 9.0		
2w	6.0 / 9.0		
1s	6.0 / 7.0		
2s	5.5 / 6.5	5.8	
3s	5.0 / 6.0	5.525/5.55	
6s	4.7 / 5.5		
9s	4.6 / 5.3		
1y	4.5 / 5.2	4.925/4.95	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	0.6/0.625	
2s	0.5 / 1.0	0.6	
3s	0.5 / 1.0	0.625	
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		
3s	0.2 / 0.5	0.23	
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5		

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafaol.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:

以上所念及附加的所有信息(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