

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-2-13】

今天美元兑人民币中间价报 6.8151，较上一交易日上调 267 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.4/6.45，3m 成交 5.35，1y 成交 4.7/4.725

RR 方面（25d），3w 成交 0.7，1m 成交 0.8，

FLY 方面（25d），1w 成交 0.3，1m/2m/3m 成交 0.26

Vanilla 方面，6m 6.9 usd call trd 420pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
2/13/2023	6.8151	267
ATM	Traded	Changes
1w	5.5 / 7.0	6.4/6.45
2w	5.5 / 7.0	
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.8 / 5.5	
3s	4.8 / 5.8	5.35
6s	4.3 / 5.3	
9s	4.3 / 5.0	
1y	4.3 / 5.0	4.7/4.725
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR	Traded	changes
1s	0.3 / 0.9	0.8
2s	0.3 / 0.9	
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	0.3
1s	0.2 / 0.5	0.26
2s	0.2 / 0.5	0.26
3s	0.2 / 0.5	0.26
6s	0.2 / 0.5	
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