

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2023-4-13】

今天美元兑人民币中间价报 6.8658, 较上一交易日下调 196 个基点。

期权 ATM 方面, 1w 成交 4.0/4.2, 1m 成交 4.8, 2m 成交 4.9/4.95, 3m 成交 4.85, 6m 成交 4.85, 1y 成交 4.75

RR 方面 (25d), 1m 成交 0.375, 2m 成交 0.42, 3m 成交 0.4

FLY 方面 (25d), 3m 成交 0.225, 1y 成交 0.245/0.2475

Vanilla 方面, 1y 7.3 usd call trd 140pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
4/13/2023	6.8658	-196
ATM	Traded	Changes
1w 3.5 / 5.0	4.0/4.2	
2w 3.5 / 5.0		
1s 4.0 / 5.5	4.8	
2s 4.5 / 5.5	4.9/4.95	
3s 4.5 / 5.5	4.85	
6s 4.5 / 5.5	4.85	
9s 4.6 / 5.3		
1y 4.5 / 5.2	4.75	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.3 / 0.8	0.375	
2s 0.3 / 0.8	0.42	
3s 0.3 / 0.8	0.4	
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	0.225	
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5		
1y 0.2 / 0.5	0.245/0.2475	

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:**

以上所述及附加的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)