

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-2-1】

今天美元兑人民币中间价报 6.7492，较上一交易日下调 112 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 6.0/6.3/6.4/6.5，2m 成交 5.7， 6m 成交 4.925/4.975，9m 成交 4.76/4.77，1y 成交 4.7/4.725

RR 方面（25d），1m 成交 0.56，2m 成交 0.675，3m 成交 0.67，1y 成交 0.75

FLY 方面（25d），1m 成交 0.3，2m 成交 0.29/0.3，3m 成交 0.29，6m 成交 0.28/0.29，9m 成交 0.29

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
2/1/2023		6.7492	-112
ATM		Traded	Changes
1w	5.5 / 8.0		
2w	5.5 / 8.0	6.0/6.3/6.4/6.5	
1s	5.8 / 6.8		
2s	5.2 / 6.0	5.7	
3s	5.0 / 5.8		
6s	4.7 / 5.3	4.925/4.975	
9s	4.3 / 5.0	4.76/4.77	
1y	4.3 / 5.0	4.7/4.725	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.2 / 0.8	0.56	
2s	0.2 / 0.8	0.675	
3s	0.3 / 0.9	0.67	
6s	0.5 / 1.0		
9s	0.5 / 1.1		
1y	0.5 / 1.1	0.75	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.3	
2s	0.2 / 0.5	0.29/0.3	
3s	0.2 / 0.5	0.29	
6s	0.2 / 0.5	0.28/0.29	
9s	0.2 / 0.5	0.29	
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