

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2023-4-25】

今天人民币兑美元中间价报 6.8847，较上一交易日调贬 12 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.3，6m 成交 4.85，9m 成交 4.84，1y 成交 4.8175 和 4.82。

RR 方面 (25d)，6m 成交 0.475，1y 成交 0.5625 和 0.55。

FLY 方面 (25d)，3w 成交 0.25，1-3m 均成交 0.23，1y 成交 0.2575 和 0.26。

Vanilla 方面，1y 7.5 call 成交 68 和 70pips，2m 6.65 put 成交 36 和 30pips。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
4/25/2023	6.8847	+12
ATM	Traded	Changes
1w 3.5 / 5.0	4.3	
2w 3.5 / 5.0		
1s 4.0 / 5.5		
2s 4.5 / 5.5		
3s 4.5 / 5.5		
6s 4.5 / 5.5	4.85	
9s 4.6 / 5.3	4.84	
1y 4.5 / 5.2	4.8175, 4.82	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.3 / 0.8		
2s 0.3 / 0.8		
3s 0.3 / 0.8		
6s 0.5 / 1.0	0.475	
9s 0.5 / 1.1		
1y 0.5 / 1.1	0.5625, 0.55	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.5		
1s 0.2 / 0.5	0.23	
2s 0.2 / 0.5	0.23	
3s 0.2 / 0.5	0.23	
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5		
1y 0.2 / 0.5	0.2575, 0.26	

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