

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-4-18】

今天人民币兑美元中间价报 6.8814，较上一交易日调贬 135 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 4.4，2m 成交 4.85，3m 成交 4.8125 和 4.8，6m 成交 4.8，1y 成交 4.73 和 4.74。

25D RR 方面，3m 成交 0.3625 和 0.35。10D RR 方面 1m 成交 0.35 和 0.4

FLY 方面 (25d)，1m 成交 0.22，2m 成交 0.225，1y 成交 0.25。另有 1y 10d fly 成交 0.6。

Vanilla 方面，1w 6.9550 call 成交 8 和 9pips，1m 6.97 call 成交 75 和 70pips，2m 7.0 call 成交 95pips，on 6.85 put 成交 10~18pips，1w 6.8 put 成交 30~40pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
4/18/2023		6.8814	+135
ATM		Traded	Changes
1w	3.5 / 5.0	4.4, 4.35	
2w	3.5 / 5.0		
1s	4.0 / 5.5		
2s	4.5 / 5.5	4.85	
3s	4.5 / 5.5	4.8125, 4.8	
6s	4.5 / 5.5	4.8	
9s	4.6 / 5.3		
1y	4.5 / 5.2	4.73, 4.74	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.3 / 0.5		
2s	0.3 / 0.5		
3s	0.3 / 0.5	0.3625, 0.35	
6s	0.3 / 0.6		
9s	0.3 / 0.6		
1y	0.3 / 0.6		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.22	
2s	0.2 / 0.5	0.225	
3s	0.2 / 0.5		
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5	0.25	

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