

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-8-3】

今天人民币兑美元中间价报 7.1495，较上一交易日调升 127 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.45，2w 成交 5.4，2m 成交 5.0，6m 成交 4.75，1y 成交 4.8

RR 方面（25d），2w 成交 par，1y 成交 0.325

FLY 方面（25d），1w 成交 0.24，2m 成交 0.1825，6m 成交 0.24，1y 成交 0.2825

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/3/2023		7.1495
ATM		127
		Traded
		Changes
1w	4.5 / 6.0	5.45
2w	5.0 / 6.0	5.4
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.5 / 5.5	5.0
3s	4.5 / 5.5	
6s	4.3 / 5.0	4.75
9s	4.3 / 5.0	
1y	4.3 / 5.0	4.8
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR		Traded
		changes
1s	0 / 0.4	
2s	0.1 / 0.4	
3s	0.2 / 0.4	
6s	0.2 / 0.5	
9s	0.2 / 0.5	
1y	0.2 / 0.5	0.325
25d FLY		Traded
		changes
1w	0.15 / 0.3	0.24
1s	0.15 / 0.3	
2s	0.15 / 0.3	0.1825
3s	0.15 / 0.3	
6s	0.15 / 0.3	0.24
9s	0.15 / 0.3	
1y	0.15 / 0.3	0.2825

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