

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-2-15】

今天美元兑人民币中间价报 6.8183，较上一交易日上调 47 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 5.45/5.55，2m 成交 5.35，3m 成交 5.15/5.2，6m 成交 4.9，9m 成交 4.775/4.8，1y 成交 4.7/4.725/4.75

RR 方面（25d），1w 成交 0.6，1m 成交 0.75，2m/6m/9m 成交 0.725

FLY 方面（25d），1m/3m 成交 0.255，2m 成交 0.25

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
2/15/2023		6.8183	47
ATM		Traded	Changes
1w	5.5 / 7.0		
2w	5.5 / 7.0		
1s	4.8 / 5.8	5.45/5.55	
2s	4.8 / 5.5	5.35	
3s	4.8 / 5.8	5.15/5.2	
6s	4.3 / 5.3	4.9	
9s	4.3 / 5.0	4.775/4.8	
1y	4.3 / 5.0	4.7/4.725/4.75	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.3 / 0.9	0.75	
2s	0.3 / 0.9	0.725	
3s	0.3 / 0.9		
6s	0.5 / 1.0	0.725	
9s	0.5 / 1.1	0.725	
1y	0.5 / 1.1		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.255	
2s	0.2 / 0.5	0.25	
3s	0.2 / 0.5	0.255	
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
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