

常规报告系列

收盘日评  
银行间外汇期权市场

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

【2023-8-7】

今天人民币兑美元中间价报 7.1380，较上一交易日下调 38 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.2，2m 成交 4.95，6m 成交 4.725，1y 成交 4.775

RR 方面（10d），9m 成交 0.68

FLY 方面（25d），1m 成交 0.1725，3m 成交 0.195/0.1975，1y 成交 0.2825

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |            |              |         |
|---------------------------|------------|--------------|---------|
| 8/7/2023                  |            | 7.1380       | -38     |
| ATM                       |            | Traded       | Changes |
| 1w                        | 4.5 / 6.0  | 5.2          |         |
| 2w                        | 5.0 / 6.0  |              |         |
| 1s                        | 4.8 / 5.8  |              |         |
| 2s                        | 4.5 / 5.5  | 4.95         |         |
| 3s                        | 4.5 / 5.5  |              |         |
| 6s                        | 4.3 / 5.0  | 4.725        |         |
| 9s                        | 4.3 / 5.0  |              |         |
| 1y                        | 4.3 / 5.0  | 4.775        |         |
| 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  |              |         |
| 25d FLY                   |            | Traded       | changes |
| 1w                        | 0.15 / 0.3 |              |         |
| 1s                        | 0.15 / 0.3 | 0.1725       |         |
| 2s                        | 0.15 / 0.3 |              |         |
| 3s                        | 0.15 / 0.3 | 0.195/0.1975 |         |
| 6s                        | 0.15 / 0.3 |              |         |
| 9s                        | 0.15 / 0.3 |              |         |
| 1y                        | 0.15 / 0.3 | 0.2825       |         |

文 / Ben Qian

联系人: Rafael Wong  
邮箱: rafael.wong@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