

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-3-16】

今天美元兑人民币中间价报 6.9149，较上一交易日上调 469 个基点。

期权 ATM 方面，3m 成交 5.7，6m 成交 5.3/5.325/5.35，9m 成交 5.2，1y 成交 5.1/5.125

RR 方面（25d），3m 成交 0.73，6m 成交 0.75

FLY 方面（25d）,2w 成交 0.25

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
3/16/2023	6.9149	469
ATM	Traded	Changes
1w 6.0 / 9.0		
2w 6.0 / 9.0		
1s 6.0 / 7.0		
2s 5.5 / 6.5		
3s 6.0 / 7.0	5.7	
6s 4.7 / 5.5	5.3/5.325/5.35	
9s 4.6 / 5.3	5.2	
1y 4.5 / 5.2	5.1/5.125	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.5 / 1.0		
2s 0.5 / 1.0		
3s 0.5 / 1.0	0.73	
6s 0.5 / 1.0	0.75	
9s 0.5 / 1.1		
1y 0.5 / 1.1		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.5		
1s 0.2 / 0.5		
2s 0.2 / 0.5		
3s 0.2 / 0.5		
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