

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-4-24】

今天美元兑人民币中间价报 6.8835，较上一交易日上调 83 个基点。

期权 ATM 方面， 9m 成交 4.825， 1y 成交 4.8/4.825/4.8375

RR 方面（25d）， 2w 成交 0.425/0.45， 1m 成交 0.4， 6m 成交 0.5， 1y 成交 0.6

FLY 方面（25d）， 1m/2m/3m 成交 0.23

Vanilla 方面， 1y 7.5 usd call trd 67/68/70pips， 9m 6.3 usd put trd 65/67/68pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
4/24/2023	6.8835	83
ATM	Traded	Changes
1w 3.5 / 5.0	,	
2w 3.5 / 5.0		
1s 4.0 / 5.5		
2s 4.5 / 5.5		
3s 4.5 / 5.5		
6s 4.5 / 5.5		
9s 4.6 / 5.3	4.825	
1y 4.5 / 5.2	4.8/4.825/4.8375	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.3 / 0.8	0.4	
2s 0.3 / 0.8		
3s 0.3 / 0.8		
6s 0.4 / 1.0	0.5	
9s 0.5 / 1.1		
1y 0.5 / 1.1	0.6	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.2 / 0.5		
1s 0.2 / 0.5	0.23	
2s 0.2 / 0.5	0.23	
3s 0.2 / 0.5	0.23	
6s 0.2 / 0.5		
9s 0.2 / 0.5		
1y 0.2 / 0.5		

文 / Daisy dai

联系人：Rafael Wong
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