



【2023-3-27】

今天美元兑人民币中间价报 6.8714，较上一交易日上调 340 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.9，6m 成交 5.175，9m 成交 5.05，1y 成交 4.9625/4.975

RR 方面（25d），2m 成交 0.55

FLY 方面（25d），3m 成交 0.22

Vanilla 方面，1y 7.3 usd call trd 185-190pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
3/27/2023		6.8714	340
ATM		Traded	Changes
1w	6.0 / 9.0	6.9	
2w	6.0 / 9.0		
1s	5.0 / 6.0		
2s	5.0 / 6.0		
3s	5.0 / 6.0		
6s	4.7 / 5.5	5.175	
9s	4.6 / 5.3	5.05	
1y	4.5 / 5.2	4.9625/4.975	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.3 / 0.8		
2s	0.3 / 0.8	0.55	
3s	0.4 / 0.9		
6s	0.5 / 1.0		
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	0.22	
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