



【2023-4-3】

今天美元兑人民币中间价报 6.8805，较上一交易日上调 88 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 6.0，3m 成交 5.47/5.5，1y 成交 4.95

RR 方面（25d），2m 成交 0.525/0.55

FLY 方面（25d），1m 成交 0.22，2m 成交 0.225，3m 成交 0.225/0.23

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |           |            |
|---------------------------|-----------|------------|
| 4/3/2023                  | 6.8805    | 88         |
| ATM                       | Traded    | Changes    |
| 1w                        | 5.0 / 7.0 | 6.0        |
| 2w                        | 6.0 / 8.0 |            |
| 1s                        | 5.0 / 6.0 |            |
| 2s                        | 5.0 / 6.0 |            |
| 3s                        | 5.0 / 6.0 | 5.47/5.5   |
| 6s                        | 4.7 / 5.5 |            |
| 9s                        | 4.6 / 5.3 |            |
| 1y                        | 4.5 / 5.2 | 4.95       |
| 2y                        | 4.5 / 6.5 |            |
| 3y                        | 4.5 / 6.5 |            |
| 25d RR                    | Traded    | changes    |
| 1s                        | 0.3 / 0.8 |            |
| 2s                        | 0.3 / 0.8 | 0.525/0.55 |
| 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 | 0.22       |
| 2s                        | 0.2 / 0.5 | 0.225      |
| 3s                        | 0.2 / 0.5 | 0.225/0.23 |
| 6s                        | 0.2 / 0.5 |            |
| 9s                        | 0.2 / 0.5 |            |
| 1y                        | 0.2 / 0.5 |            |

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**