



【2023-3-7】

今天人民币兑美元中间价报 6.9156，较上一交易日下调 205 个基点。

期权 ATM 方面，3m 成交 5.275 和 5.3,6m 成交 4.99 和 5.0，1y 成交 4.825 和 4.835，另有 1w*2w 成交-0.1，6*1y 成交-0.165。

RR 方面（25d），1m 成交 0.8

FLY 方面（25d），3m 成交 0.23，6m 成交 0.245

Vanilla 方面，2d 6.96 call 成交 45pips，6m 6.85 call 成交 865pips；2d 6.9 put 成交 30~40pips，3d 6.8 put 成交 7pips，1w 6.89 put 成交 95pips，6m 6.4 put 成交 45 和 50pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
3/7/2023	6.9156	+205
ATM	Traded	Changes
1w 6.0 / 8.0		
2w 6.0 / 8.0		
1s 5.5 / 6.5		
2s 5.3 / 5.8		
3s 5.1 / 5.6	5.275/5.3	
6s 4.8 / 5.3	4.99/5.0	
9s 4.7 / 5.2		
1y 4.6 / 5.1	4.825/4.835	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.5 / 1.0	0.8	
2s 0.5 / 1.0		
3s 0.5 / 1.0		
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	0.23	
6s 0.2 / 0.5	0.245	
9s 0.2 / 0.5		
1y 0.2 / 0.5		

联系人: Rofael Wang
邮箱: rofael.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