



【2023-2-23】

今天美元兑人民币中间价报 6.9028，较上一交易日上调 269 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.2/5.4，1m 成交 5.3/5.4/5.6，2m 成交 5.1/5.2，3m 成交 5.1，6m 成交 4.9，9m 成交 4.8，1y 成交 4.75

RR 方面（25d），1m 成交 0.75/0.8，2m 成交 0.75，9m 成交 0.75

Vanilla 方面，9m 6.4 usd put trd 125pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
2/23/2023		6.9028	269
ATM		Traded	Changes
1w	5.0 / 6.5	5.2/5.4	
2w	5.0 / 6.5		
1s	4.8 / 5.8	5.3/5.4/5.6	
2s	4.8 / 5.5	5.1/5.2	
3s	4.8 / 5.8	5.1	
6s	4.3 / 5.3	4.9	
9s	4.3 / 5.0	4.8	
1y	4.3 / 5.0	4.75	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	0.75/0.8	
2s	0.5 / 1.0	0.75	
3s	0.5 / 1.0		
6s	0.5 / 1.0		
9s	0.5 / 1.1	0.75	
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