



【2023-4-4】

今天人民币兑美元中间价报 6.8699，较上一交易日上调 106 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.7~5.9 区间，2w 成交 5.8，2m 成交 5.5，3m 成交 5.37 和 5.325，6m 成交 5.05，9m 成交 4.95、4.925 和 4.9，1y 成交 4.9 和 4.85

RR 方面（25d），2m 成交 0.55。另有 3m 10d rr 成交 0.9

FLY 方面（25d），1m 成交 0.23，2m 成交 0.23 和 0.2325，3m 成交 0.2325，6m 成交 0.2425 和 0.245

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
4/4/2023		6.8699	-106
ATM		Traded	Changes
1w	5.0 / 7.0	5.7~5.9	
2w	5.0 / 7.0	5.8	
1s	5.0 / 6.0		
2s	5.0 / 6.0	5.5	
3s	5.0 / 6.0	5.37, 5.325	
6s	4.7 / 5.5	5.05	
9s	4.6 / 5.3	4.95, 4.925, 4.9	
1y	4.5 / 5.2	4.9, 4.85	
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	0.23	
2s	0.2 / 0.5	0.23, 0.2325	
3s	0.2 / 0.5	0.2325	
6s	0.2 / 0.5	0.2425, 0.245	
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