



【2023-2-7】

今天人民币兑美元中间价报 6.7967，较上一交易日下调 230 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.75、5.8 和 5.85，1m 成交 5.4 和 5.45，9m 成交 4.65

FLY 方面（25d），1m 成交 0.28 和 0.27

RR 方面，9m 25d rr 成交 0.7，1y 25d rr 成交 0.725，3m 10d rr 成交 1.2 和 1.225，9m 10d rr 成交 1.33

Vanilla 方面，3w 6.9 call 成交 50 和 52pips，1y 7.3 call 成交 125pips，on 6.75 put 成交 15pips，2w 6.72 put 成交 95pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
2/7/2023		6.7967	+230
ATM		Traded	Changes
1w	5.5 / 7.0	5.75, 5.8, 5.85	
2w	5.5 / 7.0		
1s	4.8 / 5.8	5.4, 5.45	
2s	4.8 / 5.5		
3s	4.8 / 5.8	5.25	
6s	4.3 / 5.3		
9s	4.3 / 5.0	4.65	
1y	4.3 / 5.0		
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.2 / 0.8		
2s	0.2 / 0.8		
3s	0.3 / 0.9		
6s	0.5 / 1.0		
9s	0.5 / 1.1	0.7	
1y	0.5 / 1.1	0.725	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.28, 0.27	
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		

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