



【2023-3-21】

今天人民币兑美元中间价报 6.8763，较上一交易日下调 69 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 7.0、7.1 和 7.2，1m 成交 6.15，另有 3*1y 成交-0.575、-0.5625 和-0.55，9*1y 成交-0.075

RR 方面（25d），3m 成交 0.6

RR 方面（10d），1w 成交 0.5，2m 成交 1.05

FLY 方面（25d），1m 和 2m 均成交 0.225，6m 成交 0.25

Vanilla 方面 1w 6.93 call 成交 80pips，3m 6.88 call 成交 520pips，1y 7.3 call 成交 195pips，on 6.87 put 成交 60~70pips 区间，1m 6.71 put 成交 63~70pips 区间

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
3/21/2023		6.8763	+69
ATM		Traded	Changes
1w	6.0 / 9.0	7.0, 7.1, 7.2	
2w	6.0 / 9.0		
1s	5.8 / 6.5	6.15	
2s	5.5 / 6.3		
3s	5.0 / 6.0		
6s	4.7 / 5.5		
9s	4.6 / 5.3		
1y	4.5 / 5.2		
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.5 / 0.8		
2s	0.5 / 0.8		
3s	0.5 / 0.8	0.6	
6s	0.5 / 0.8		
9s	0.5 / 0.8		
1y	0.5 / 0.8		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.4		
1s	0.2 / 0.4	0.225	
2s	0.2 / 0.4	0.225	
3s	0.2 / 0.4		
6s	0.2 / 0.4	0.25	
9s	0.2 / 0.4		
1y	0.2 / 0.4		

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