



【2023-2-21】

今天人民币兑美元中间价报 6.8557，较上一交易日上调 86 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 5.025，1m 成交 5.3，2m 成交 5.15 和 5.2，3m 成交 5.075 和 5.1，6m 成交 4.9

RR 方面（25d），1m 成交 0.75，2m 成交 0.775，3m 成交 0.775，6m 成交 0.77，1y 成交 0.78 和 0.8

FLY 方面（25d），1m 成交 0.23

Vanilla 方面，1m 6.95 call 成交 118 和 130pips，1m 7.0 call 成交 60、55 和 62pips，1y 7.5 call 成交 85pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
2/21/2023		6.8557	-86
ATM		Traded	Changes
1w	4.5 / 5.5		
2w	4.5 / 5.5	5.025	
1s	5.0 / 5.5	5.3	
2s	4.8 / 5.5	5.15, 5.2	
3s	4.8 / 5.8	5.075	
6s	4.7 / 5.0	4.9	
9s	4.6 / 5.0		
1y	4.5 / 5.0		
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	0.75	
2s	0.5 / 1.0	0.775	
3s	0.5 / 1.0	0.775	
6s	0.5 / 1.0	0.77	
9s	0.5 / 1.1		
1y	0.5 / 1.1	0.78, 0.8	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.23	
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