



【2023-3-2】

今天美元兑人民币中间价报 6.8808，较上一交易日下调 592 个基点。

期权 ATM 方面，3m 成交 5.2，1y 成交 4.775/4.8/4.825

RR 方面（25d），1m 成交 0.8，6m 成交 0.825，9m/1y 成交 0.8

FLY 方面（25d），1m/6m 成交 0.24，2m/3m 成交 0.235，1y 成交 0.265

Vanilla 方面，9m 6.3 usd put trd 50pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
3/2/2023		6.8808	-592
ATM		Traded	Changes
1w	5.0 / 6.5		
2w	5.0 / 6.5		
1s	5.0 / 6.0		
2s	4.8 / 5.8		
3s	4.8 / 5.8	5.2	
6s	4.3 / 5.3		
9s	4.3 / 5.0		
1y	4.3 / 5.0	4.775/4.8/4.825	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	0.8	
2s	0.5 / 1.0		
3s	0.5 / 1.0		
6s	0.5 / 1.0	0.825	
9s	0.5 / 1.1	0.8	
1y	0.5 / 1.1	0.8	
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5	0.24	
2s	0.2 / 0.5	0.235	
3s	0.2 / 0.5	0.235	
6s	0.2 / 0.5	0.24	
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5	0.265	

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