



【2023-7-28】

今天人民币兑美元中间价报 7.1338，较上一交易日上调 73 个基点。

期权 ATM 方面， 1w 成交 5.8， 6m 成交 4.775， 9m 成交 4.775

RR 方面（25d）， 9m 成交 0.3

FLY 方面（25d）， 2m 成交 0.1875/0.19

Vanilla 方面，今天短期成交比较多，on 7.19 usd call 成交 25pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
7/28/2023	7.1338	73
ATM	Traded	Changes

1w	5.0 / 7.0	5.8
2w	5.0 / 6.5	
1s	4.8 / 5.8	
2s	4.5 / 5.5	
3s	4.5 / 5.5	
6s	4.3 / 5.0	4.775
9s	4.3 / 5.0	4.775
1y	4.3 / 5.0	
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
	25d RR	Traded changes
1s	0 / 0.4	
2s	0.1 / 0.4	
3s	0.2 / 0.4	
6s	0.2 / 0.5	
9s	0.2 / 0.5	0.3
1y	0.2 / 0.5	
	25d FLY	Traded changes
1w	0.15 / 0.3	
1s	0.15 / 0.3	
2s	0.15 / 0.3	0.1875/0.19
3s	0.15 / 0.3	
6s	0.15 / 0.3	
9s	0.15 / 0.3	
1y	0.15 / 0.3	

文 / Ben Qian

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