



【2023-8-21】

今天人民币兑美元中间价报 7.1987，较上一交易日上调 19 个基点。

期权 ATM 方面， 1w 成交 5.8~5.5 区间收在 5.6， 6m 成交 5.15

RR 方面， 4m 35d rr 成交 0.3

FLY 方面（25d）， 3w 成交 0.19， 1m 成交 0.1875， 2m 成交 0.2， 3m 成交 0.22， 9m 成交 0.29、 1y 成交 0.2875

Vanilla 方面， 2d 7.3330 call 成交 35pips， 1w7.25 put 成交 65、 62 和 70pips， 2w 7.2 put 成交 40 和 35pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/21/2023	7.1987	-19
ATM	Traded	Changes
1w 5.0 / 7.0	5.8~5.5	
2w 5.0 / 7.0		
1s 5.5 / 6.5		
2s 5.0 / 5.8		
3s 5.0 / 5.8		
6s 4.5 / 5.5	5.15	
9s 4.5 / 5.5		
1y 4.5 / 5.5		
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.1 / 0.4		
2s 0.1 / 0.4		
3s 0.2 / 0.4		
6s 0.3 / 0.6		
9s 0.3 / 0.6		
1y 0.3 / 0.6		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.15 / 0.3		
1s 0.15 / 0.3	0.19	
2s 0.15 / 0.3	0.2	
3s 0.15 / 0.3	0.22	
6s 0.15 / 0.3		
9s 0.15 / 0.3	0.29	
1y 0.15 / 0.3	0.2875	

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