



【2022-11-25】

今天美元兑人民币中间价报 7.1339，较上一交易日上调 138 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 8.6，1m 成交 8.45/8.5，3m 成交 6.82/6.85，6m 成交 5.9，9m 成交 5.575，1y 成交 5.4/5.425

RR 方面（25d），2m 成交 0.65，3m 成交 0.7

FLY 方面（25d），1m 成交 0.22，3m 成交 0.23

Vanilla 方面，

| CFETS-NEX FX OPTION RECAP |            |           |         |
|---------------------------|------------|-----------|---------|
| 11/25/2022                |            | 7.1339    | 138     |
| ATM                       |            | Traded    | Changes |
| 1w                        | 8.0 / 11.0 | 8.6       |         |
| 2w                        | 8.0 / 11.0 |           |         |
| 1s                        | 7.5 / 9.0  | 8.45/8.5  |         |
| 2s                        | 7.0 / 8.0  |           |         |
| 3s                        | 6.5 / 7.5  | 6.82/6.85 |         |
| 6s                        | 5.5 / 6.5  | 5.9       |         |
| 9s                        | 5.0 / 6.0  | 5.575     |         |
| 1y                        | 5.0 / 6.0  | 5.4/5.425 |         |
| 2y                        | 4.5 / 6.5  |           |         |
| 3y                        | 4.5 / 6.5  |           |         |
| 25d RR                    |            | Traded    | changes |
| 1s                        | 0.2 / 0.8  |           |         |
| 2s                        | 0.2 / 0.8  | 0.65      |         |
| 3s                        | 0.3 / 0.9  | 0.7       |         |
| 6s                        | 0.5 / 1.5  |           |         |
| 9s                        | 0.5 / 1.5  |           |         |
| 1y                        | 0.5 / 1.5  |           |         |
| 25d FLY                   |            | Traded    | changes |
| 1w                        | 0.2 / 0.5  |           |         |
| 1s                        | 0.2 / 0.5  | 0.22      |         |
| 2s                        | 0.2 / 0.5  |           |         |
| 3s                        | 0.2 / 0.5  | 0.23      |         |
| 6s                        | 0.2 / 0.5  |           |         |
| 9s                        | 0.2 / 0.5  |           |         |
| 1y                        | 0.2 / 0.5  |           |         |

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