



【2022-12-02】

今天美元兑人民币中间价报 7.0542，较上一交易日下调 683 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 10.0，1m 成交 8.8/8.85/9.0/9.2，3m 成交 6.9/7.0，6m 成交 5.9/5.95。

RR 方面（25d），1m 成交 0.25/0.3/0.4，2m 成交 0.4/0.45。

FLY 方面（25d），1m 成交 0.24，1y 成交 0.27。

Vanilla 方面，ON 7.1 usd call trd 37pips。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
12/2/2022		7.0542	-683
ATM		Traded	Changes
1w	8.0 / 11.0	10	
2w	8.0 / 11.0		
1s	7.5 / 9.0	8.8/8.85/9.0/9.2	
2s	7.0 / 8.0		
3s	6.5 / 7.5	6.9/7.0	
6s	5.5 / 6.5	5.9/5.95	
9s	5.0 / 6.0		
1y	5.0 / 6.0		
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.2 / 0.8	0.25/0.3/0.4	
2s	0.2 / 0.8	0.4/0.45	
3s	0.3 / 0.9		
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	0.24	
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	0.27	

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