



【2022-11-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1989，较上一交易日调贬 372 个基点，期权市场整体成交较少。

ATM 波动率方面，6m 成交 6.05

FLY 方面（25d），1y 成交 0.275

Vanilla 成交相对较为活跃，1w 7.1 put 市场成交 125pips，3m 6.8 put 成交 95pips，6m 6.8 put 成交 270~310pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/29/2022		7.1989	+372
ATM		Traded	Changes
1w	8.5 / 13.0		
2w	8.5 / 12.0		
1s	8.5 / 9.5		
2s	7.5 / 8.5		
3s	6.5 / 7.5		
6s	5.5 / 6.5	6.05	
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	0.4 / 1.0		
2s	0.5 / 1.0		
3s	0.5 / 1.0		
6s	0.6 / 1.3		
9s	0.7 / 1.3		
1y	0.8 / 1.3		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.2 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5		
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	0.275	

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