

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2022-11-9】

今天美元兑人民币中间价报 7.2189，较上一交易日上调 39 个基点。

期权 ATM 方面，2m 成交 7.8， 3m 成交 7.075， 6m 成交 6.2， 9m 成交 5.75/5.775/5.8， 1y 成,5.65/5.7。

RR 方面（25d） ， 3m 成交 0.95， 1y 成交 0.975。

Vanilla 方面， 11m 8.0 usd call trd 90pips。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
9/11/2022		7.2189	39
ATM		Traded	Changes
1w	9.0 / 12.0		
2w	8.0 / 11.0		
1s	7.5 / 9.0		
2s	7.0 / 8.0	7.8	
3s	6.5 / 7.5	7.075	
6s	5.5 / 6.5	6.2	
9s	5.0 / 6.0	5.75/5.775/5.8	
1y	5.0 / 6.0	,5.65/5.7	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0.8 / 2.0		
2s	0.8 / 1.8		
3s	0.8 / 1.8	0.95	
6s	0.7 / 1.7		
9s	0.7 / 1.7		
1y	0.7 / 1.7	0.975	
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		

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