常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-11-22】

今天人民币兑美元中间价报 7.1667，较上一交易日调贬 411 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 8.9 和 8.95，6m 成交 6.05、6.0 和 5.95，9m 成交 5.6，1y 成交 5.45。

FLY 方面（25d），1m 和 2m 均成交 0.21，1y 成交 0.26。

Vanilla 方面市场 2w 7.25 call 成交 200pips，1y 7.2 call 成交 670~680pips 区间，1w 7.09 put 成交 155 和 170pips。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	11/22/2022	7.1667	+411
	ATM	Traded	Changes
1w	9.0 / 12.0		
2w	8.5 / 11.0		
1s	8.5 / 9.5	8.9, 8.95	
2s	7.5 / 8.0		
3s	6.5 / 7.5		
6s	5.5 / 6.5	6.05, 6.0, 5.95	
9s	5.0 / 6.0	5.6	
1y	5.0 / 6.0	5.45	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	0.2 / 0.8		
2s	0.2 / 0.8		
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 / 0.3		
1s	0.2 / 0.3	0.21	
2s	0.2 / 0.3	0.21	
3s	0.2 / 0.3		
6s	0.2 / 0.3		
9s	0.2 / 0.3		
1y	0.2 / 0.3	0.26	

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。