

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2022-11-18】

今天美元兑人民币中间价报 7.1091，较上一交易日上调 436 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 9.5/10.5，1m 成交 8.6，3m 成交 6.6/6.7，6m 成交 5.75/5.85，9m 成交 5.575，1y 成交 5.3/5.4

RR 方面（25d），3m 成交 0.7/0.75

FLY 方面（25d），2m/3m 成交 0.2

Vanilla 方面，3m 6.9 usd put trd 250pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/17/2022		7.1091	436
ATM		Traded	Changes
1w	9.0 / 12.0	9.5/10.5	
2w	8.5 / 11.0		
1s	7.5 / 9.0	,8.6	
2s	7.0 / 8.0		
3s	6.5 / 7.5	6.6/6.7	
6s	5.5 / 6.5	5.75/5.85	
9s	5.0 / 6.0	5.575	
1y	5.0 / 6.0	5.3/5.4	
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	0.7/0.75	
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		
2s	0.2 / 0.5	0.2	
3s	0.2 / 0.5	0.2	
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5		

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