

收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



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

【2022-11-17】

今天美元兑人民币中间价报 7.0655，较上一交易日上调 292 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 9.4/9.5，1m 成交 8.4/8.5，2m 成交 7.25，3m 成交 6.5，6m 成交 5.6，1y 成交 5.25/5.3。

FLY 方面（25d），2m 成交 0.22/0.23。

Vanilla 方面，1y 6.5 usd put trd 165/170/175pips。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/17/2022		7.0655	292
ATM		Traded	Changes
1w	9.0 / 12.0		
2w	8.5 / 11.0	9.4/9.5	
1s	7.5 / 9.0	8.4/8.5	
2s	7.0 / 8.0	7.25	
3s	6.5 / 7.5	6.5	
6s	5.5 / 6.5	5.6	
9s	5.0 / 6.0		
1y	5.0 / 6.0	5.25/5.3	
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 / 0.5		
1s	0.2 / 0.5		
2s	0.2 / 0.5	0.22/0.23	
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:
以上所登及附加的所有信息（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