

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2022-11-21】

今天美元兑人民币中间价报 7.1256，较上一交易日上调 165 个基点。

期权 ATM 方面，2w 成交 9.9，1m 成交 8.8，2m 成交 7.6，6m 成交 6.0， 1y 成交 5.45。

RR 方面（25d），9m 成交 0.9。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
11/21/2022	7.1256	165
ATM	Traded	Changes
1w	9.0 / 12.0	
2w	8.5 / 11.0	9.9
1s	7.5 / 9.0	8.8
2s	7.0 / 8.0	7.6
3s	6.5 / 7.5	
6s	5.5 / 6.5	6.0
9s	5.0 / 6.0	
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	0.9
1y	0.5 / 1.5	
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