

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



【2022-11-30】

今天美元兑人民币中间价报 7.1769，较上一交易日下调 220 个基点。

期权 ATM 方面，on 成交 175pips/l，1w 成交 10.3，6m 成交 6.1/6.15，

RR 方面（25d），1y 成交 0.85

FLY 方面（25d），9m 成交 0.27

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
11/30/2022		7.1769	-220
ATM		Traded	Changes
1w	8.0 / 11.0	10.3	
2w	8.0 / 11.0		
1s	7.5 / 9.0		
2s	7.0 / 8.0		
3s	6.5 / 7.5		
6s	5.5 / 6.5	6.1/6.15	
9s	5.0 / 6.0		
1y	5.0 / 6.0		
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	0.85	
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	0.27	
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