

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

【2021-04-21】

今天美元兑人民币中间价报 6.5046, 较上一交易日下调 57 个基点。

ATM 方面, 听闻市场 1w 成交 3.5, 2w 成交 3.725, 1m 成交 3.925

RR 方面 (25d), 1m 成交 0.2, 市场亦有 0.225/0.25 成交, 听闻市场 2w 成交 0.1, 2m 成交 0.35

FLY 方面 (25d), 听闻市场 1w/2w/1m 均成交 0.325

Vanilla 方面, 1m 6.63 usd call 成交 30pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	04/21/2021	6.5046	-57
	ATM	Traded	Changes
1w	3.3 / 3.8	3.5	
2w	3.4 / 3.9	3.725	
1s	3.7 / 4.1	3.925	
2s	3.8 / 4.3		
3s	4.0 / 4.4		
6s	4.2 / 4.7		
9s	4.3 / 4.8		
1y	4.4 / 4.9		
2y	4.5 / 5.0		
3y	4.5 / 5.1		
	25d RR	Traded	changes
1s	0.1 / 0.4	0.2/0.225/0.25	
2s	0.2 / 0.5	0.35	
3s	0.2 / 0.6		
6s	0.3 / 0.7		
9s	0.3 / 0.7		
1y	0.4 / 0.7		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.3 / 0.5	0.325	
1s	0.3 / 0.5	0.325	
2s	0.3 / 0.5		
3s	0.3 / 0.5		
6s	0.3 / 0.5		
9s	0.3 / 0.5		
1y	0.3 / 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:

以上所念及附加的所有信息(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