

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2021-01-21】

今天美元兑人民币中间价报 6.4696，较上一交易上调 140 个基点。

ATM 方面，1w 成交 3.6/3.65/3.7，听闻市场也有 3.75 成交，3m 市场成交 4.45，1y eur/cny 成交 5.8，听闻市场 9m 成交 4.55，9m eur/cny 成交 5.825

RR 方面，听闻市场 9m 25d rr 成交 0.45

FLY 方面，听闻市场 2w、3w、1m 皆成交 0.4

Vanilla 方面，1w 6.4750 usd call 成交 85/87.5pips，2w 6.4 usd put 成交 25/27pips，听闻市场亦有 20pips 成交，2021/2/10 6.6 usd call 成交 25.5pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
01/21/2021	6.4696	140
ATM	Traded	Changes
1w 3.7 / 4.2	3.6/3.65/3.75	
2w 3.8 / 4.3		
1s 4.2 / 4.5		
2s 4.4 / 4.7		
3s 4.4 / 4.7	4.45	
6s 4.4 / 4.85		
9s 4.4 / 4.9	4.55	
1y 4.4 / 4.9		
2y 4.5 / 5.0		
3y 4.5 / 5.1		
25d RR	Traded	changes
1s -0.3 / 0.1		
2s -0.2 / 0.2		
3s -0.1 / 0.3		
6s 0.2 / 0.4		
9s 0.3 / 0.6	0.45	
1y 0.4 / 0.7		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.3 / 0.5		
1s 0.3 / 0.5	0.4	
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: Rofael Wang  
邮箱: rofael.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