

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



**【2021-01-22】**

今天美元兑人民币中间价报 6.4617，较上一交易日下调 79 个基点。

ATM 方面，1w 成交 3.7，市场也有 3.5 成交，6m 成交 4.55，听闻市场 3m 成交 4.475,1y 成交 4.575/4.6

RR 方面，听闻市场 2w 25d rr 成交 0.05，1m 25d rr 成交 0.05，3m 25d rr 成交 0.225

FLY 方面，3w 25d fly 成交 0.4，听闻市场 1m 25d fly 成交 0.4，1y 10d fly 成交 0.7

Vanilla 方面，1y 8.5 eur call 成交 730/740pips，市场也有 735pips 成交，1y 7.95 usd call 成交 18pips，市场也有 16pips 成交，2w 6.4 usd put 成交 20pips，2m 6.6 usd call 成交 175pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
01/22/2021	6.4617	-79
ATM	Traded	Changes
1w	3.7 / 4.2	3.5/3.7
2w	3.8 / 4.3	
1s	4.2 / 4.5	
2s	4.4 / 4.7	
3s	4.4 / 4.7	4.475
6s	4.4 / 4.85	4.55
9s	4.4 / 4.9	
1y	4.4 / 4.9	4.575/4.6
2y	4.5 / 5.0	
3y	4.5 / 5.1	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.3 / 0.1	0.05
2s	-0.2 / 0.2	
3s	-0.1 / 0.3	0.225
6s	0.2 / 0.4	
9s	0.3 / 0.6	
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: Rafeel Wang  
邮箱: rafeel.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:**

以上所提及及附加的所有信息（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**