

# 收盘日评 银行间外汇期权市场

常规报告系列



【2021-04-23】

今天美元兑人民币中间价报 6.4934，较上一交易日上调 32 个基点。

ATM 方面，1m 成交 3.9，市场亦有 3.875 成交，3m 成交 4.2/4.225/4.25，1y 成交 4.625，市场亦有 4.6125 成交，听闻市场 o/n 成交 40pips，1w 成交 3.45，6m 成交 4.5

RR 方面 (25d)，听闻市场 1m 成交 0.25，2m 成交 0.35，6m 成交 0.45

FLY 方面 (25d)，2m/3m 成交 0.3375，听闻市场 1w/2w 成交 0.35

Vanilla 方面，2m 6.7\*6.65 usd call sprd 成交 55pips，听闻市场 6M 7.2 usd call 成交 21/22pips，1m 6.6 usd call 成交 65pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
04/23/2021		6.4934	32
ATM		Traded	Changes
1w	3.2 / 3.7	3.45	
2w	3.4 / 3.9		
1s	3.7 / 4.1	3.875/3.9	
2s	3.8 / 4.3		
3s	4.0 / 4.4	4.2/4.2125/4.225/4.25	
6s	4.3 / 4.7	4.5	
9s	4.3 / 4.8		
1y	4.4 / 4.9	4.6125/4.625	
2y	4.5 / 5.0		
3y	4.5 / 5.1		
25d RR		Traded	changes
1s	0.1 / 0.4	0.25	
2s	0.2 / 0.5	0.35	
3s	0.2 / 0.6		
6s	0.3 / 0.7	0.45	
9s	0.3 / 0.7		
1y	0.4 / 0.7		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.3 / 0.5	0.35	
1s	0.3 / 0.5		
2s	0.3 / 0.5	0.3375	
3s	0.3 / 0.5	0.3375	
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: 以上所述及附加的所有信息 (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推介、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