

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

【2021-02-25】

今天美元兑人民币中间价报 6.4522，较上一交易日下调 93 个基点。

ATM 方面，2m 成交 4.35，3m 成交 4.525/4.55，9m 成交 4.675，1y 成交 4.7/4.75，听闻市场 1w 成交 3.7/3.75/3.8，1m 成交 4.175/4.1875/4.2，2m 成交 4.325/4.3375，3m 成交 4.5，6m 成交 4.6/4.625/4.65，9m 成交 4.7，1y 成交 4.725，2y 成交 4.825

RR 方面，2w 25d rr 成交 0.025

FLY 方面，听闻市场 2w 25d fly 成交 0.4，1m 25d fly 成交 0.4，2m 25d fly 成交 0.39，3m 25d fly 成交 0.3875，9m 25d fly 成交 0.4

Vanilla 方面，O/N 6.47 usd call 成交 10pips，4m 6.6 usd call 成交 385pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
02/25/2021		6.4522	-93
ATM		Traded	Changes
1w	3.6 / 4.3	3.7/3.75/3.8	
2w	3.7 / 4.3		
1s	4.1 / 4.5	4.175/4.1875/4.2	
2s	4.1 / 4.5	4.325/4.3375/4.35	
3s	4.1 / 4.6	4.5/4.525/4.55	
6s	4.4 / 4.85	4.6/4.625/4.65	
9s	4.4 / 4.9	4.675/4.7	
1y	4.4 / 4.9	4.7/4.725/4.75	
2y	4.5 / 5.0	4.825	
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		
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	0.39	
3s	0.3 / 0.5	0.3875	
6s	0.3 / 0.5		
9s	0.3 / 0.5	0.4	
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:

以上所提及的所有信息(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