

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

【2026-03-03】

今天人民币兑美元中间价报 6.9088，较上一交易日调升 148 个基点。

期权今日市场活跃成交较多，ATM 方面成交水平较上个交易日略有浮动，1w 成交 3.3/3.4/3.45/3.5，2w 成交 3.3，1m 成交 3.025/3.05/3.075，2m 成交 3.05，3m 成交 3.075/3.1，6m 成交 3.325/3.35/3.365，9m 成交 3.525/3.55，1y 成交 3.7/3.71。

BF 方面（25d），1m 成交 0.1875，2m 成交 0.1925，3m 成交 0.2，6m 成交 0.2175，9m 成交 0.2425。

RR 方面（25d），1m 成交 0/0.025/0.1。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
03/03/2026	6.9088	+148
ATM	Traded	Changes
1w	2.0/4.0	3.3/3.4/3.45/3.5
2w	2.0/4.0	
1s	1.0/4.0	3.025/3.05/3.075
2s	1.0/4.0	3.05
3s	2.0/4.0	3.075/3.1
6s	2.0/4.0	3.325/3.35/3.365
9s	2.0/5.0	3.525/3.55
1y	2.0/5.0	3.7/3.71
2y	2.0/5.0	
3y	2.0/5.0	
25d RR	Traded	changes
1s	-0.2/0.3	0/0.025/0.1
2s	-0.2/0.3	
3s	-0.2/0.3	
6s	-0.2/0.3	
9s	-0.2/0.3	
1y	-0.2/0.3	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.05/0.2	
1s	0.15/0.25	0.1875
2s	0.15/0.25	0.1925
3s	0.15/0.25	0.2
6s	0.15/0.25	0.2175
9s	0.20/0.30	0.2425
1y	0.20/0.30	

免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。