

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

【2026-03-06】

今天人民币兑美元中间价报 6.9025，较上一交易日调贬 18 个基点。

期权今日 ATM 方面 1w 成交 3.8/4.0，2w 成交 3.6，1m 成交 3.35，3m 成交 3.2/3.225，6m 成交 3.375，9m 成交 3.515/3.525/3.54，1y 成交 3.675/3.7。
BF 方面（25d），1m 成交 0.15，3m 成交 0.185。
RR 方面（25d），1y 成交-0.05。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
03/06/2026		6.9025	-18
ATM	Traded	Changes	
1w	2.0/5.0	3.8/4.0	
2w	2.0/5.0	3.6	
1s	1.0/4.0	3.35	
2s	1.0/4.0		
3s	2.0/4.0	3.2/3.225	
6s	2.0/4.0	3.375	
9s	2.0/5.0	3.515/3.525/3.54	
1y	2.0/5.0	3.675/3.7	
2y	2.0/5.0		
3y	2.0/5.0		
25d RR	Traded	changes	
1s	-0.1/0.3		
2s	-0.1/0.3		
3s	-0.1/0.3		
6s	-0.2/0.3		
9s	-0.2/0.3		
1y	-0.2/0.3	-0.05	
25d FLY	Traded	changes	
1w	0.1/0.2		
1s	0.1/0.2	0.15	
2s	0.1/0.2		
3s	0.15/0.25	0.185	
6s	0.15/0.25		
9s	0.20/0.30		
1y	0.20/0.30		

免责声明：本日报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、发表或引用日报内容。日报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报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。