

# 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

【2026-04-02】

今天人民币兑美元中间价报 6.888，较上一交易日调升 145 个基点。

期权今日 ATM 方面，短端波动率较上个交易日有所跌幅，1w 成交 3.65，2w 成交 3.5，1m 成交 3.15/3.2，2m 成交 3.175，3m 成交 3.155，6m 成交 3.275，1y 成交 3.5/3.525。

BF 方面（25d），9m 成交 0.1625，1y 成交 0.17。

RR 方面（25d），2m 成交 0.05，3m 成交 0.05，9m 成交-0.025，1y 成交-0.01。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
04/02/2026	6.888	+145
ATM	Traded	Changes
1w 2.0/5.0	3.65	
2w 2.0/5.0	3.5	
1s 2.0/5.0	3.15/3.2	
2s 2.0/5.0	3.175	
3s 2.0/4.0	3.155	
6s 2.0/4.0	3.275	
9s 2.0/5.0		
1y 2.0/5.0	3.5/3.525	
2y 2.0/5.0		
3y 2.0/5.0		
25d RR	Traded	changes
1s -0.1/0.3		
2s -0.1/0.3	0.05	
3s -0.1/0.3	0.05	
6s -0.2/0.3		
9s -0.2/0.3	-0.025	
1y -0.2/0.3	-0.01	
25d FLY	Traded	changes
1w 0.0/0.05		
1s 0.0/0.1		
2s 0.05/0.15		
3s 0.05/0.2		
6s 0.05/0.2		
9s 0.05/0.25	0.1625	
1y 0.05/0.25	0.17	

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。