

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

【2026-06-11】

今天人民币兑美元中间价报 6.8150，较上一交易日调贬 20 个基点。

期权今日市场成交活跃，ATM 方面，成交水平较上一交易日下行，1w 成交 1.8，2m 成交 2.125，3m 成交 2.3，6m 成交 2.725/2.75，9m 成交 3.025/3.05，1y 成交 3.225/3.25。

RR 方面（25d），2m 成交 0.025，1y 成交 -0.14。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP

06/11/2026	6.8150	-20
ATM	Traded	Changes
1w 1.0/4.0	1.8	
2w 1.0/4.0		
1s 1.0/3.0		
2s 1.0/3.0	2.125	
3s 2.0/4.0	2.3	
6s 2.0/4.0	2.725/2.75	
9s 2.0/5.0	3.025/3.05	
1y 2.0/5.0	3.225/3.25	
2y 2.0/5.0		

3y	2.0/5.0		
	25d RR	Trade	changes
1s	-0.3/0.1		
2s	-0.3/0.1	0.025	
3s	-0.2/0.1		
6s	-0.2/0.1		
9s	-0.2/0.1		
1y	-0.2/0.1	-0.14	
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.0/0.15		
1s	0.0/0.15		
2s	0.05/0.15		
3s	0.05/0.2		
6s	0.05/0.2		
9s	0.05/0.25		
1y	0.05/0.25		