

核心观点

历史波动率上升的有：沪深300、300ETF（沪）、沪金、玉米、白糖、菜粕

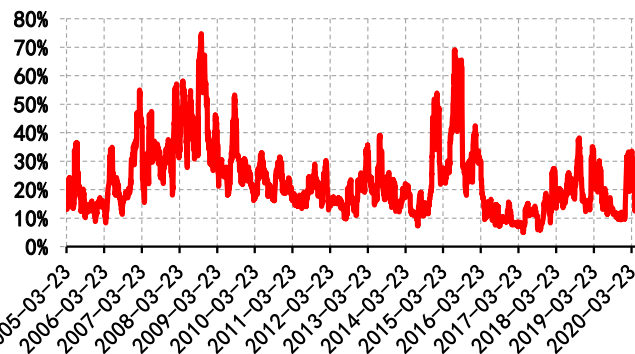
历史波动率下降的有：50ETF、300ETF（深）、沪铜、沪胶、豆粕、铁矿石、甲醇、棉花、PTA

看涨期权隐波显著高于看跌期权的有：

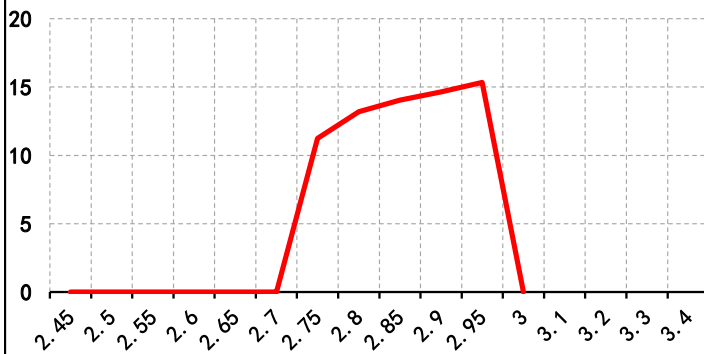
看跌期权隐波显著高于看涨期权的有：50ETF、300ETF（沪）、300ETF（深）、沪深300

上交所期权

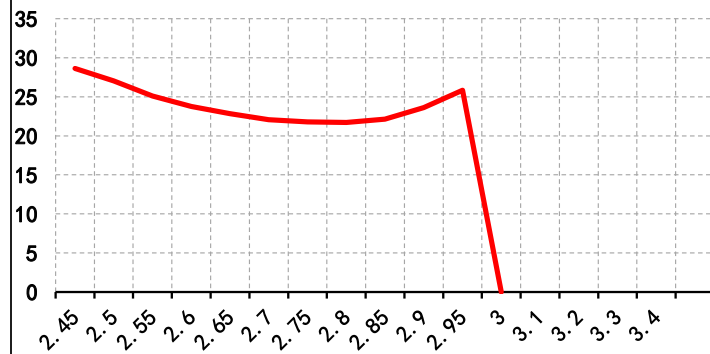
上证50ETF20日历史波动率



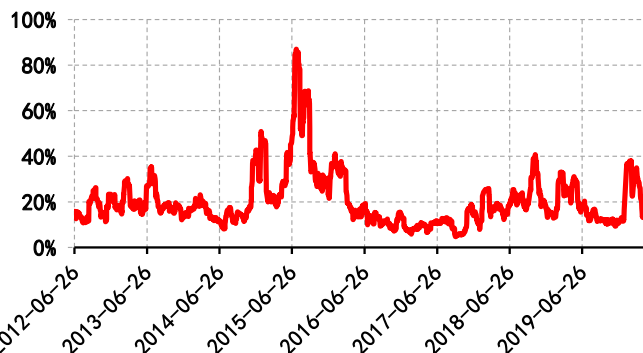
上证50ETF看涨期权隐含波动率
202005



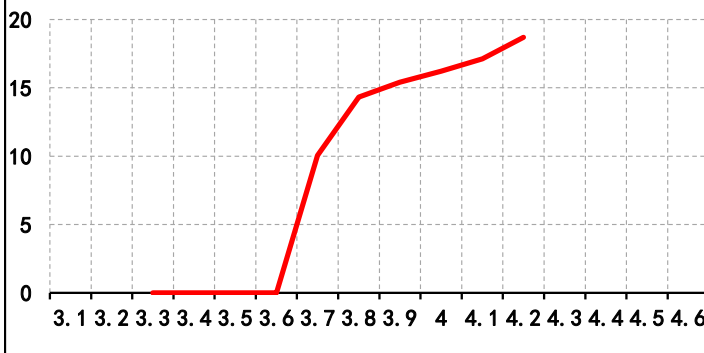
上证50ETF看跌期权隐含波动率
202005



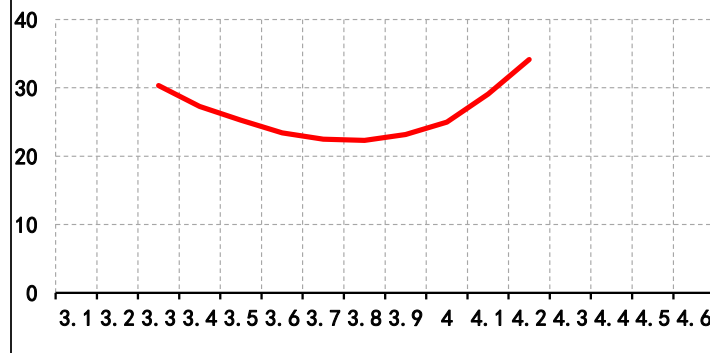
沪深300ETF（沪）20日历史波动率



沪深300ETF（沪）看涨期权隐含波动率
202005

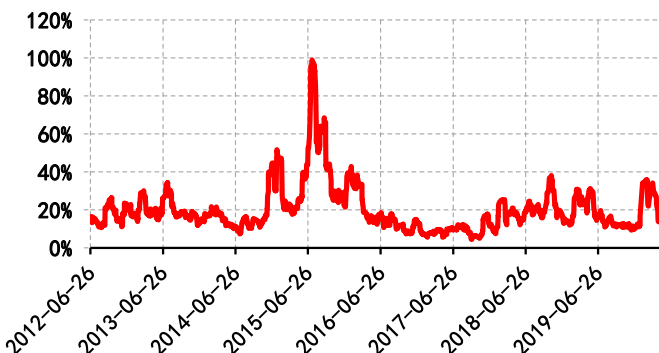


沪深300ETF（沪）看跌期权隐含波动率
202005

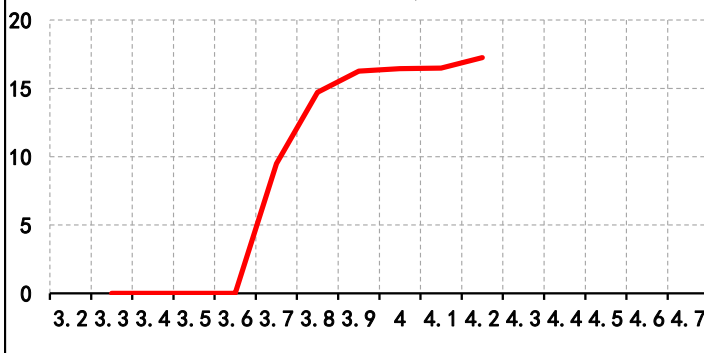


深交所期权

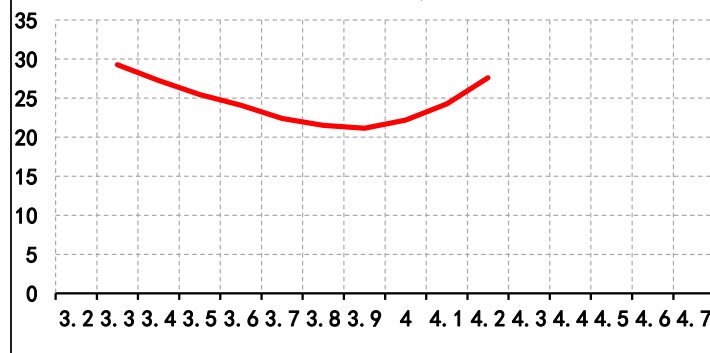
沪深300ETF（深）20日历史波动率



沪深300ETF（深）看涨期权隐含波动率
系列1

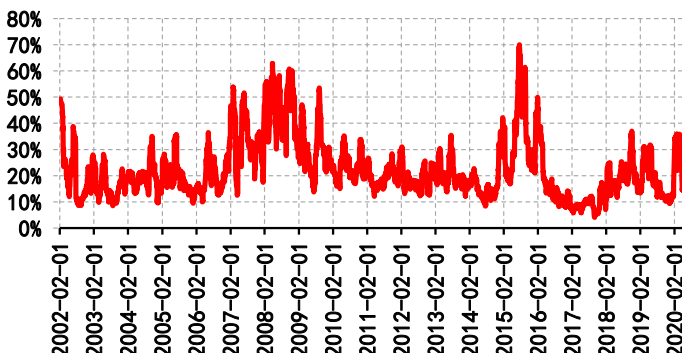


沪深300ETF（深）看跌期权隐含波动率
系列1

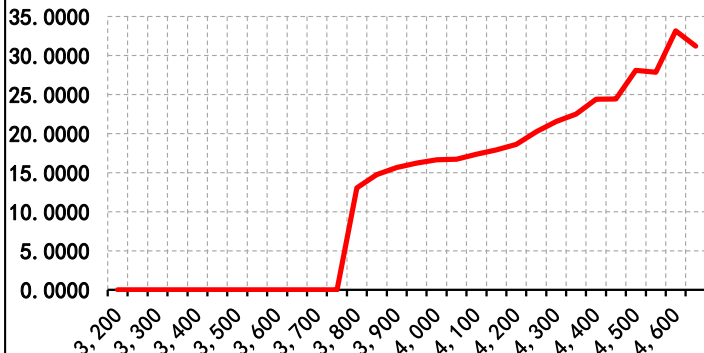


中金所期权

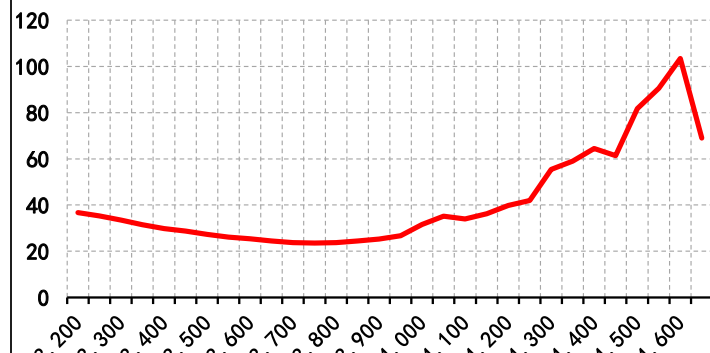
沪深300指数20日历史波动率

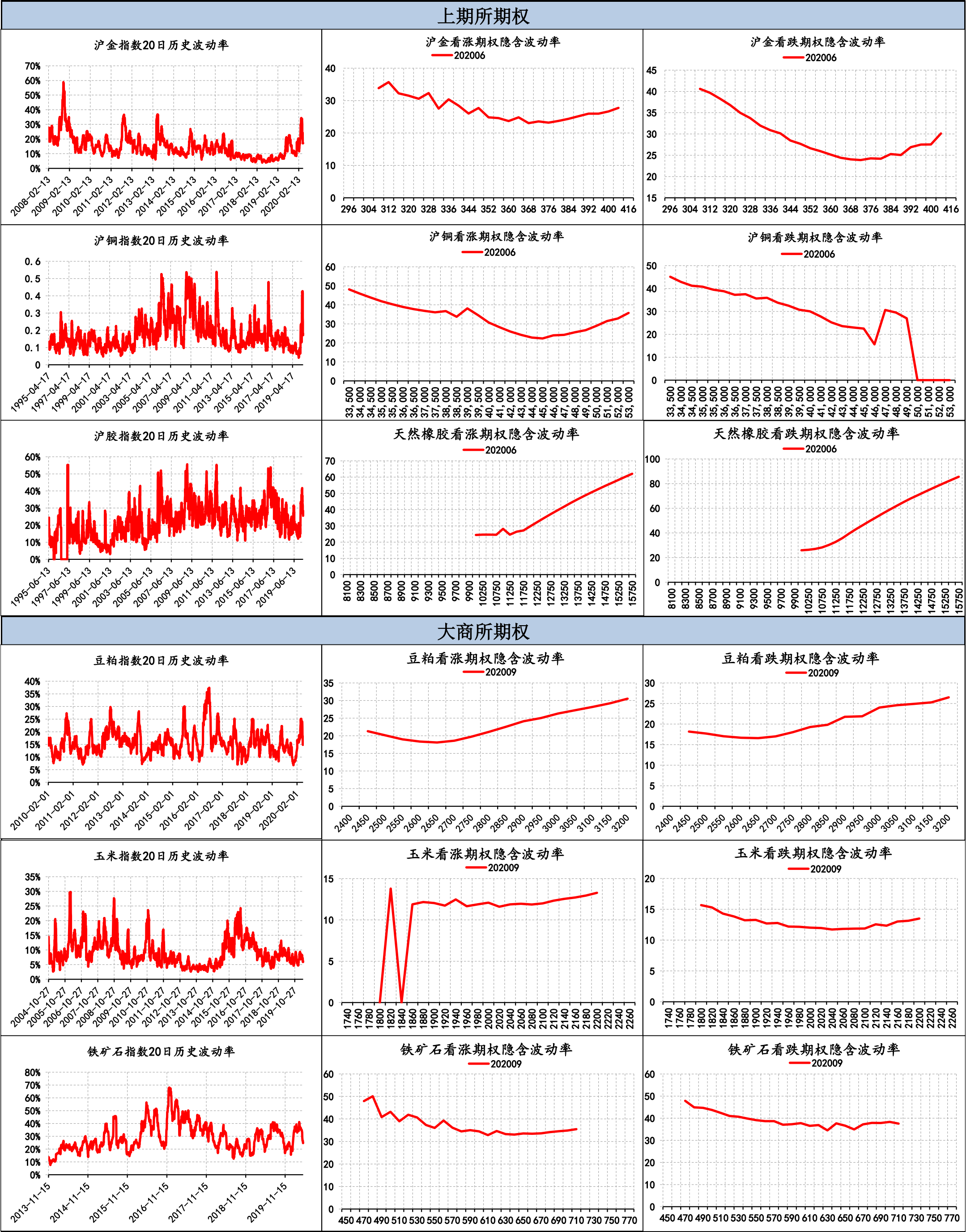


沪深300指数看涨期权隐含波动率
202005



沪深300指数看跌期权隐含波动率
202005





沪胶指数20日历史波动率

天然橡胶看涨期权隐含波动率

202006

天然橡胶看跌期权隐含波动率

202006

大商所期权

豆粕指数20日历史波动率

豆粕看涨期权隐含波动率

202009

豆粕看跌期权隐含波动率

202009

玉米指数20日历史波动率

玉米看涨期权隐含波动率

202009

玉米看跌期权隐含波动率

202009

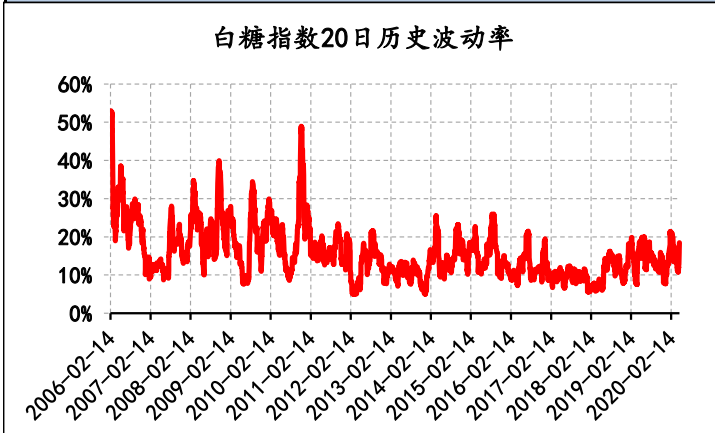
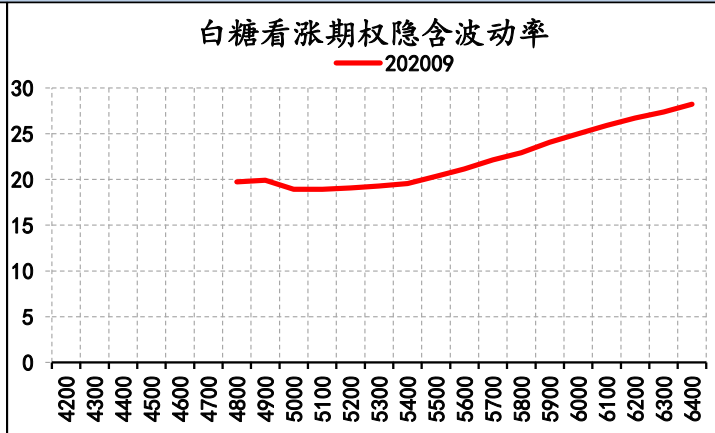
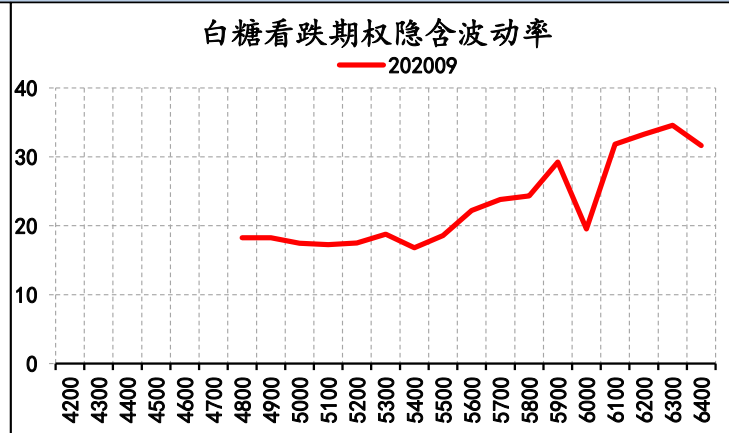
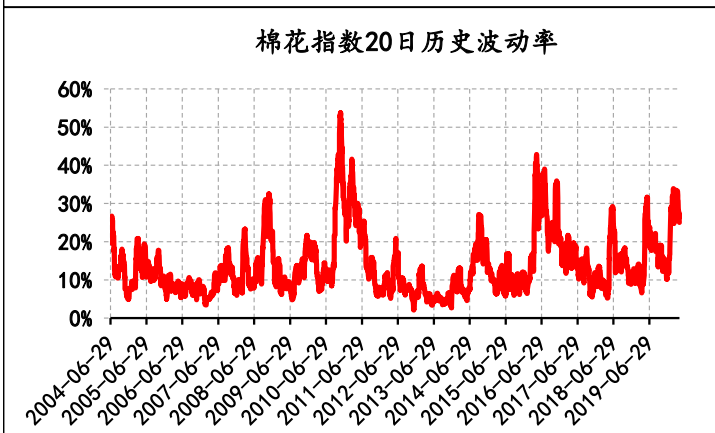
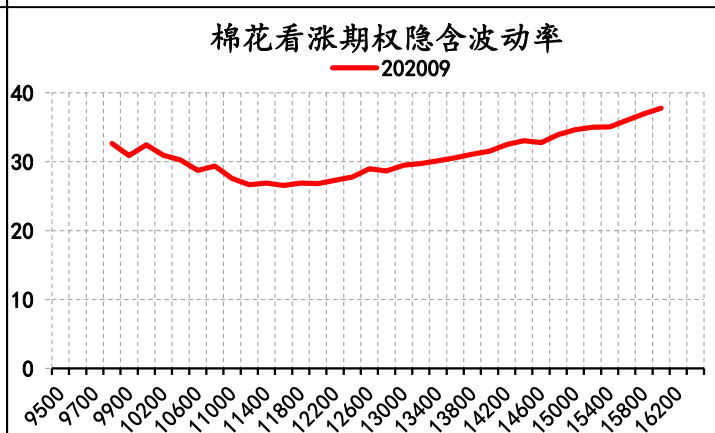
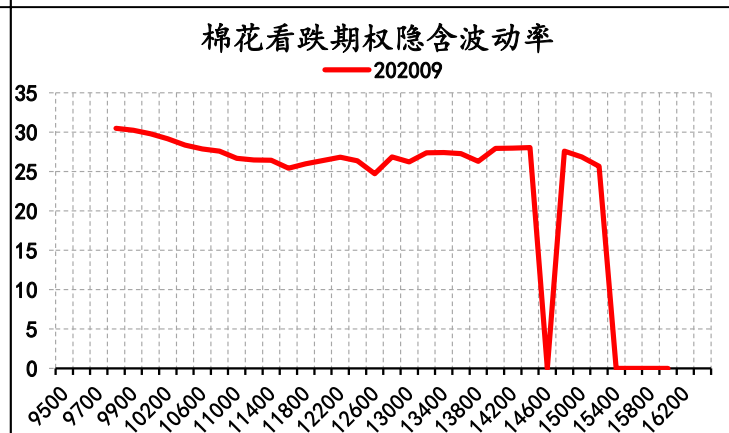
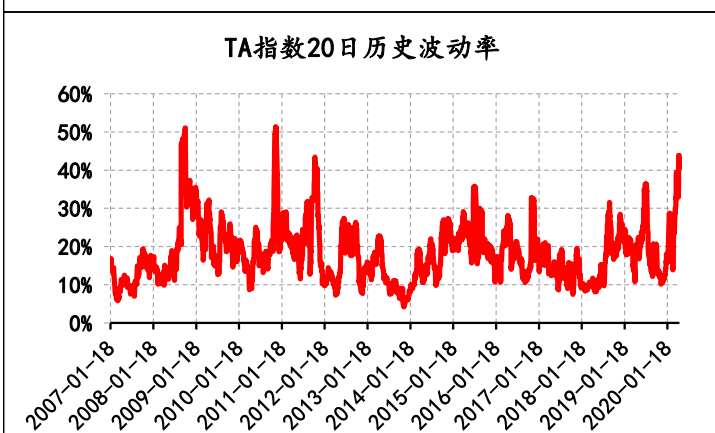
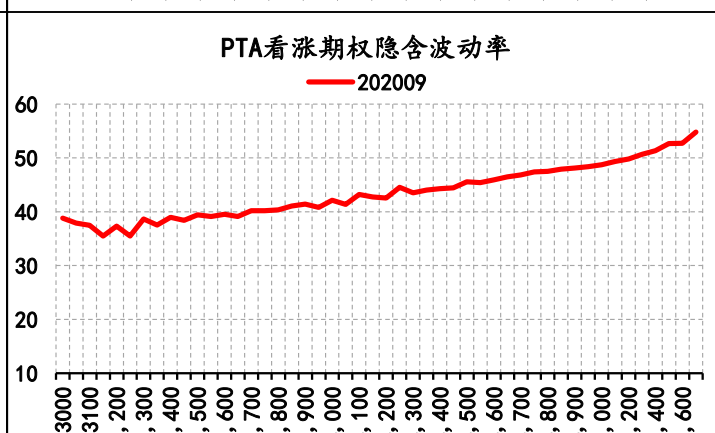
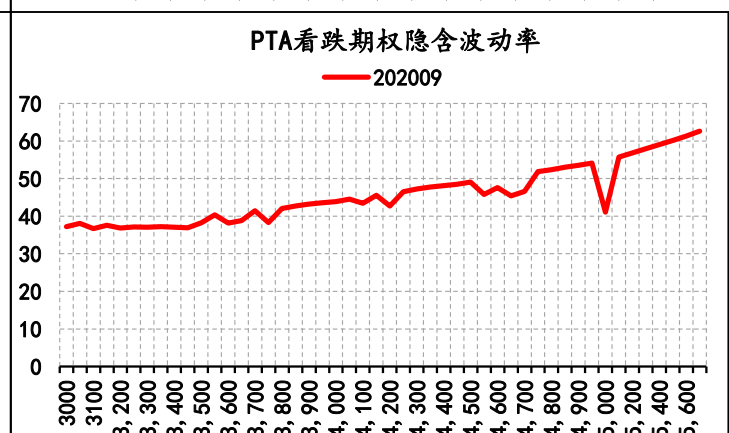
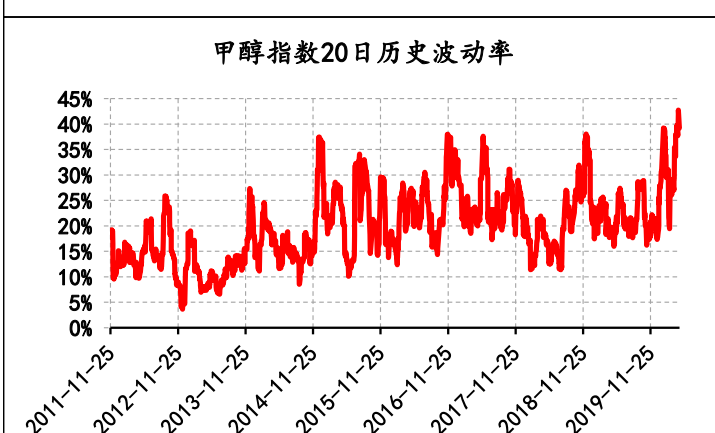
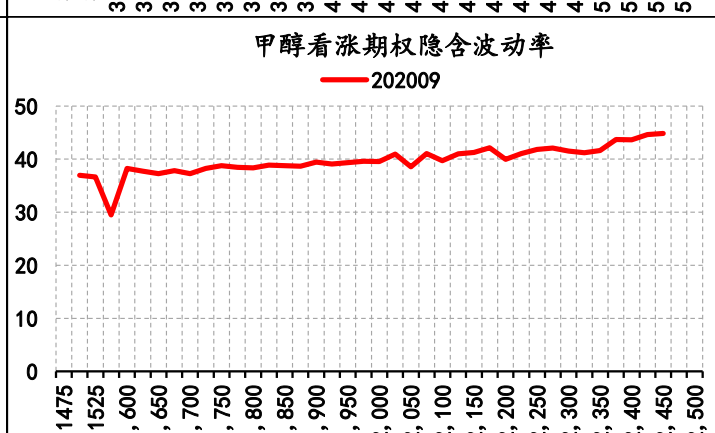
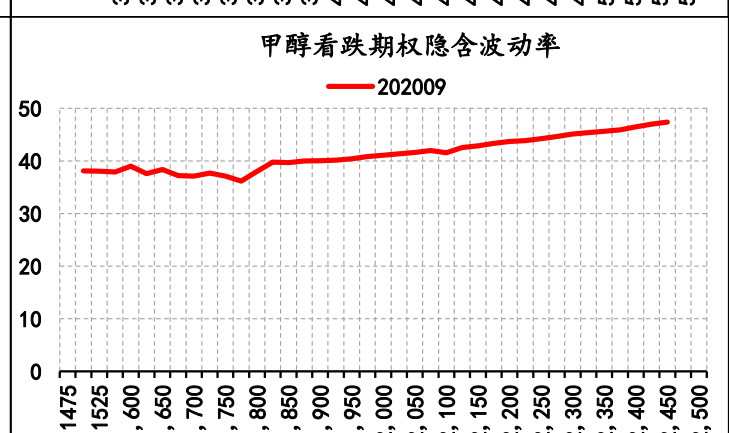
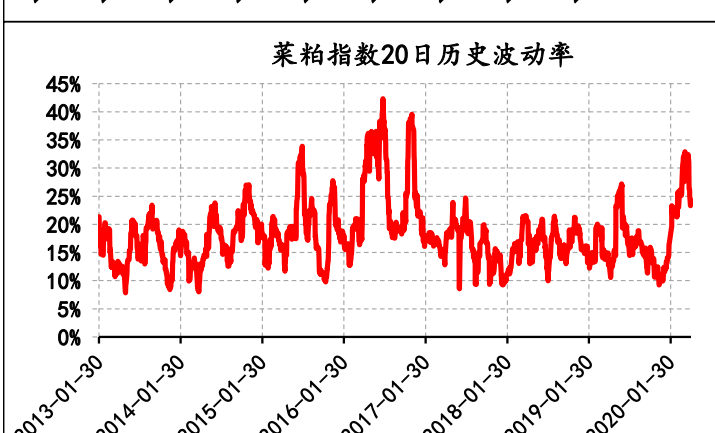
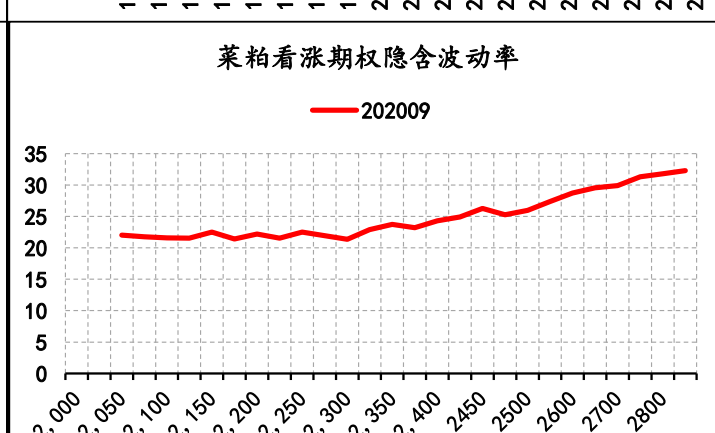
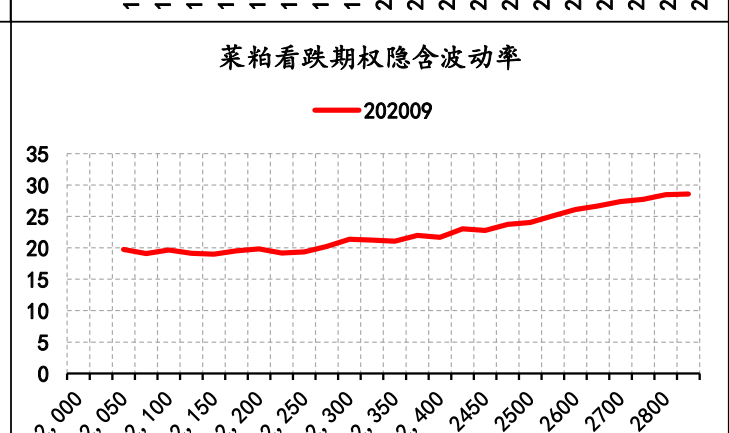
铁矿石指数20日历史波动率

铁矿石看涨期权隐含波动率

202009

铁矿石看跌期权隐含波动率

202009

郑商所期权					
白糖指数20日历史波动率 		白糖看涨期权隐含波动率 202009 		白糖看跌期权隐含波动率 202009 	
棉花指数20日历史波动率 		棉花看涨期权隐含波动率 202009 		棉花看跌期权隐含波动率 202009 	
TA指数20日历史波动率 		PTA看涨期权隐含波动率 202009 		PTA看跌期权隐含波动率 202009 	
甲醇指数20日历史波动率 		甲醇看涨期权隐含波动率 202009 		甲醇看跌期权隐含波动率 202009 	
菜粕指数20日历史波动率 		菜粕看涨期权隐含波动率 202009 		菜粕看跌期权隐含波动率 202009 	
 联系人：郭远爱（投资咨询资格-Z0013488） 电话：0571-28132630/18758264396 邮箱：guoyuanai@cindasc.com	 联系人：吴昕岚（执业资格-F3062655） 电话：0571-28132630/15700085884 邮箱：wuxinlan@cindasc.com	 联系人：骆奇泉（执业资格-F3063756） 电话：0571-28132592			
报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。					