

核心观点

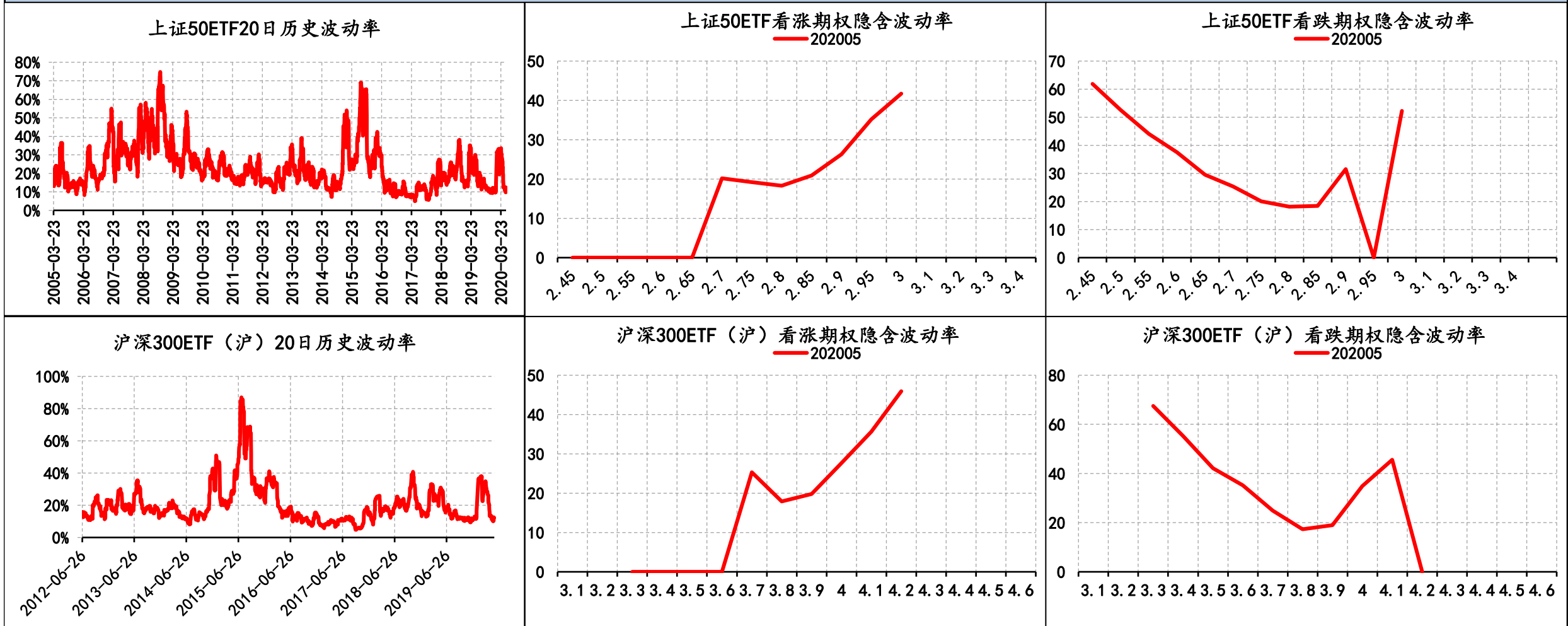
历史波动率上升的有：豆粕、玉米、白糖、菜粕

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

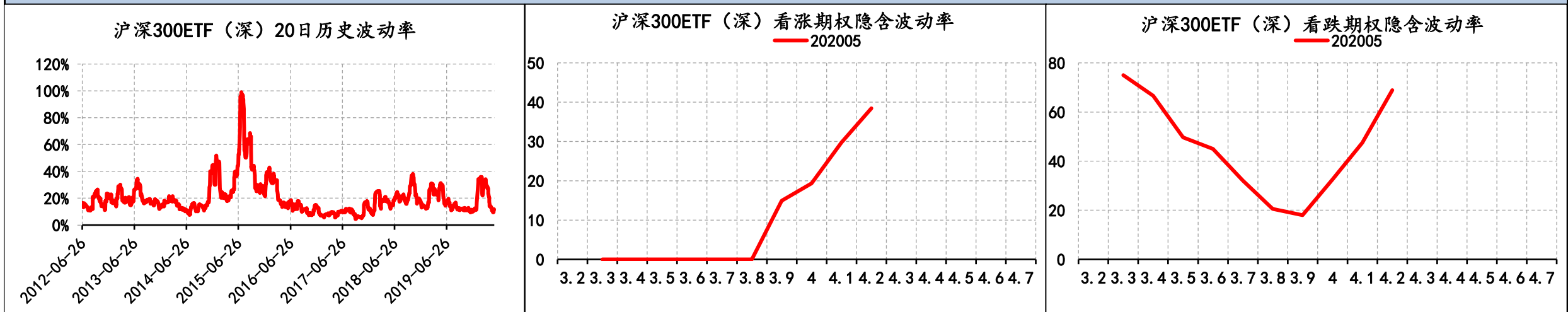
看涨期权隐波显著高于看跌期权的有：

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

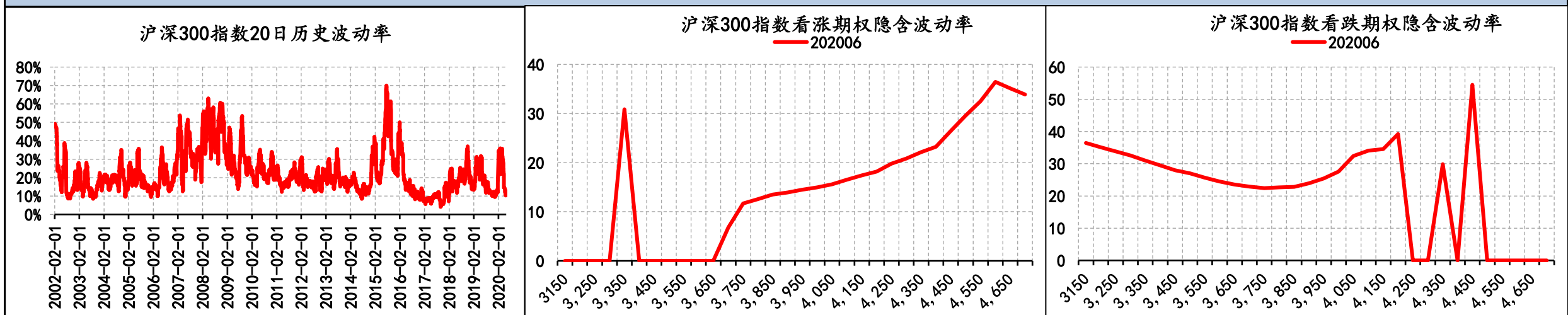
上交所期权



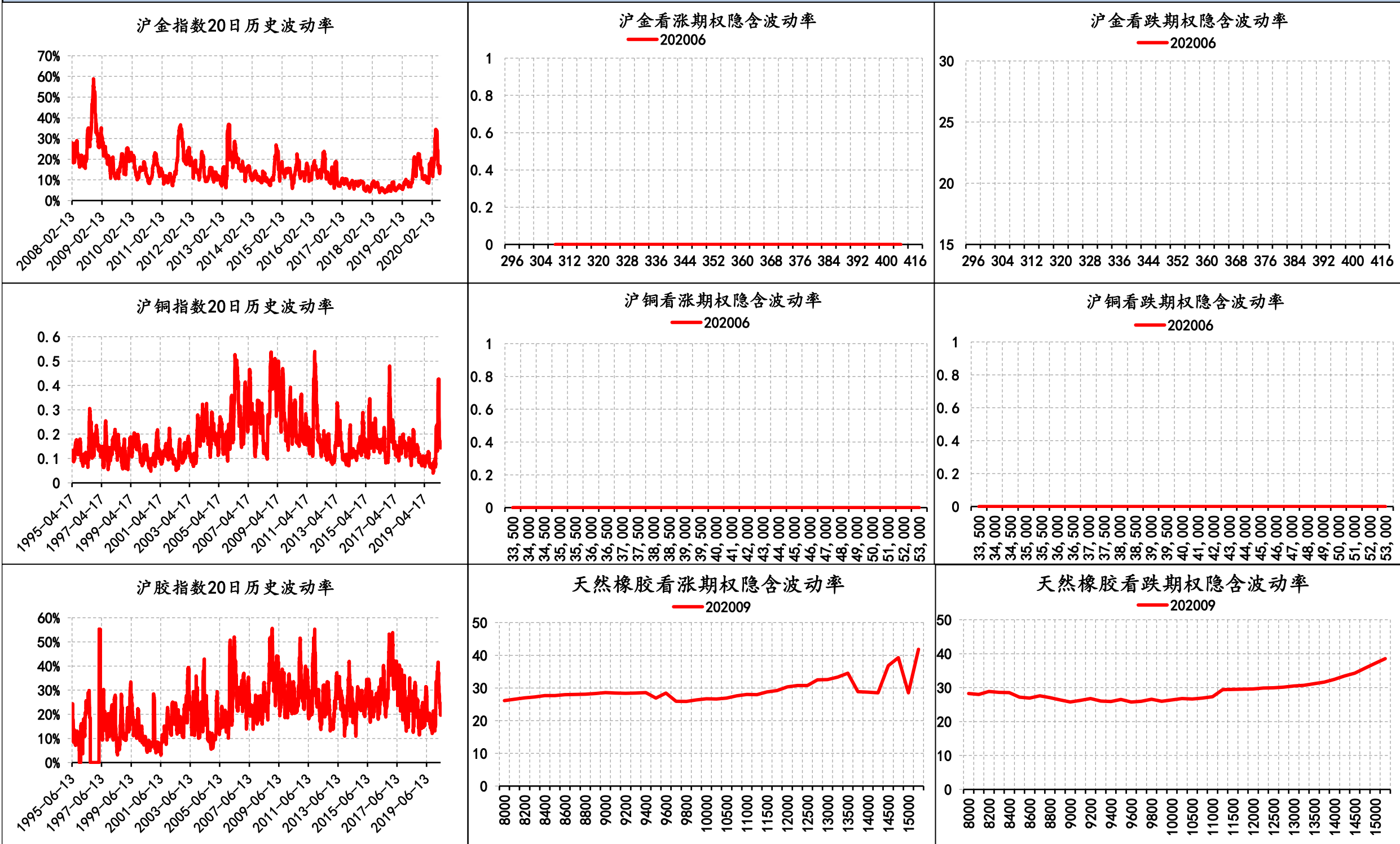
深交所期权



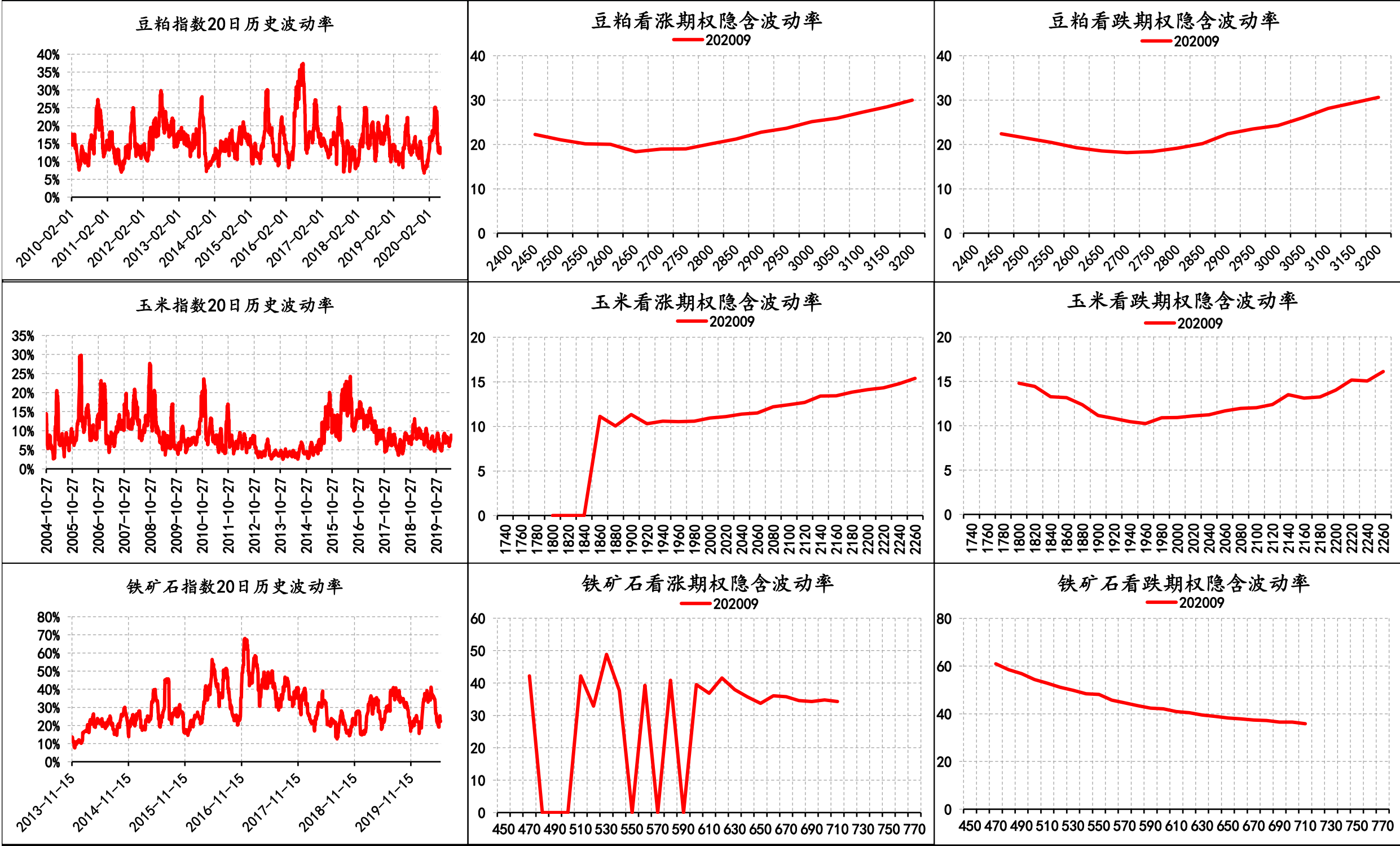
中金所期权

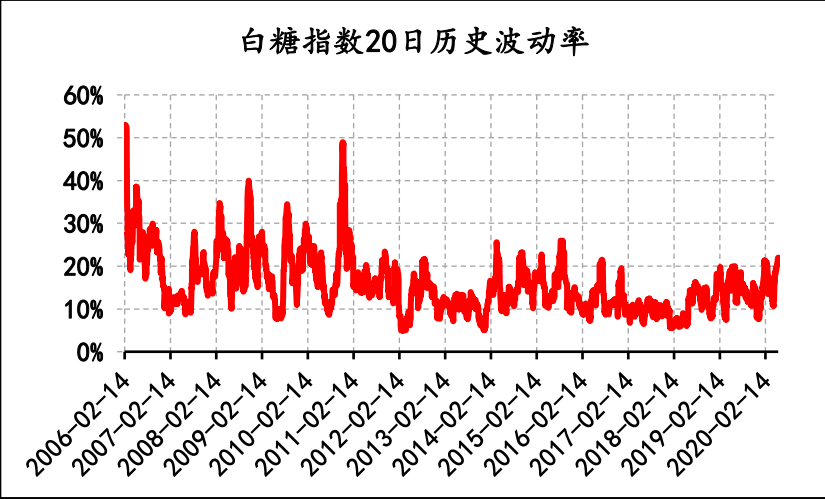
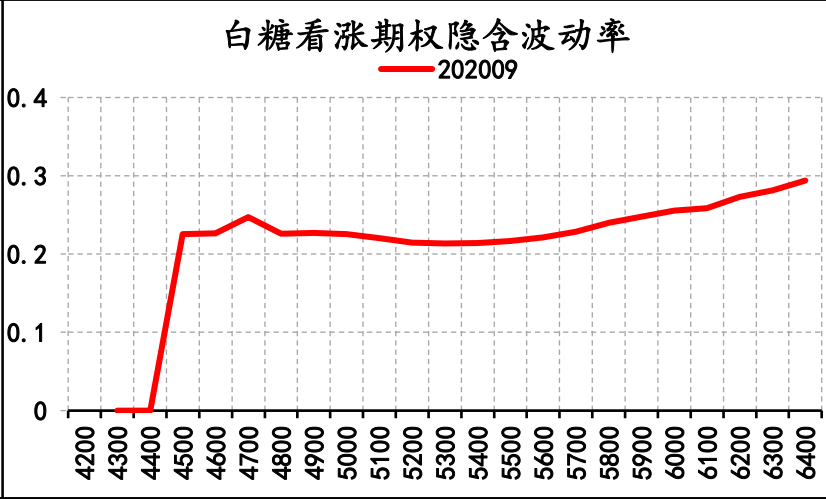
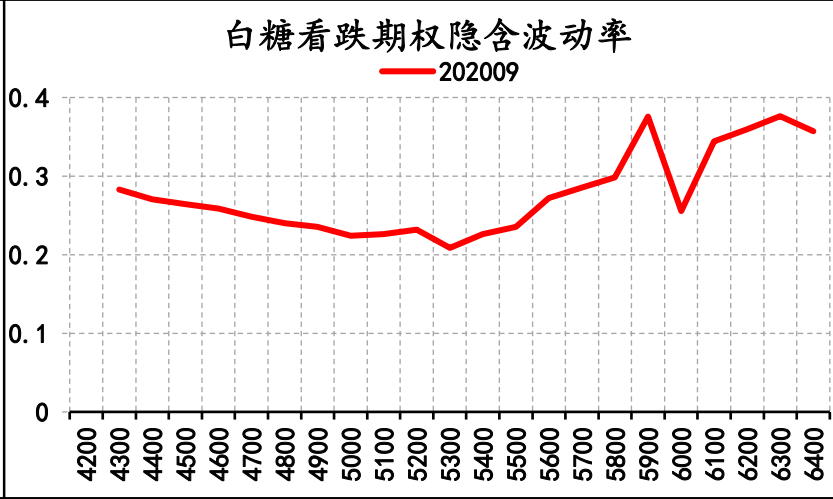
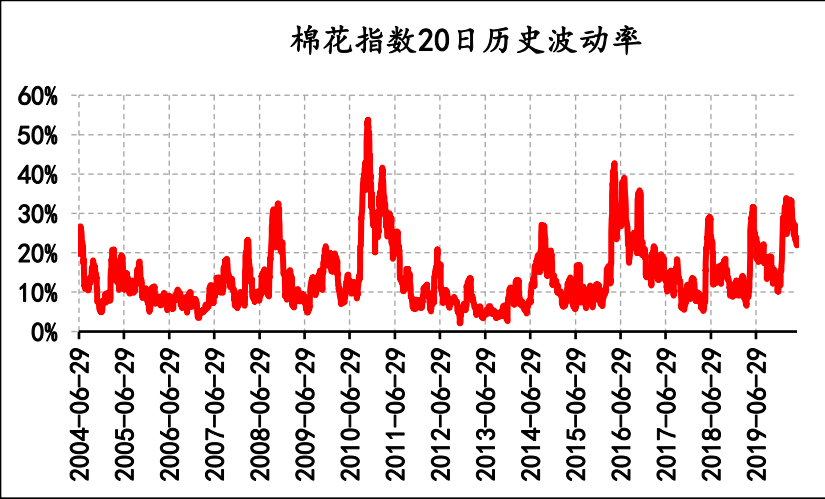
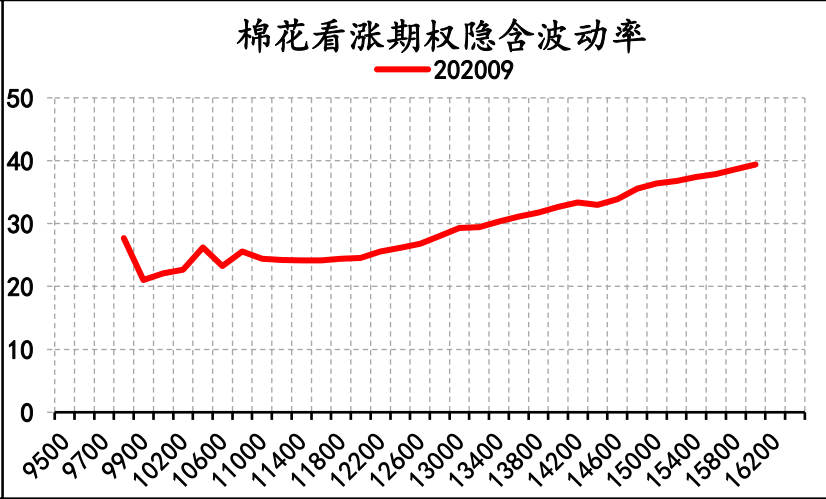
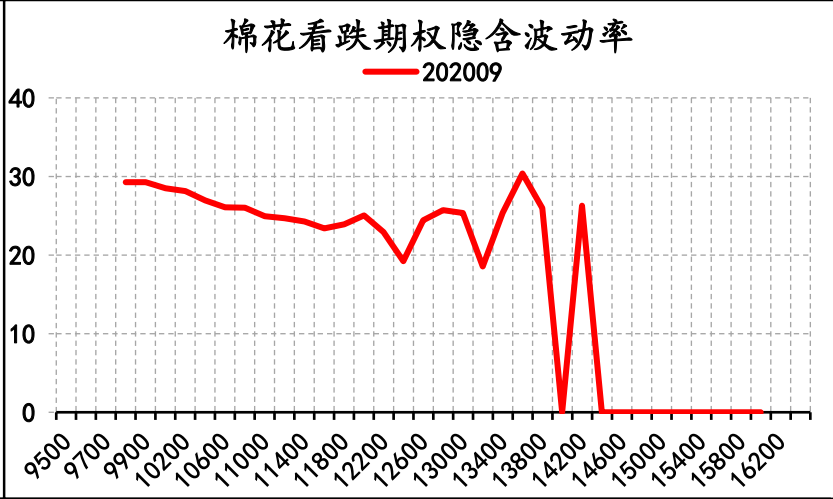
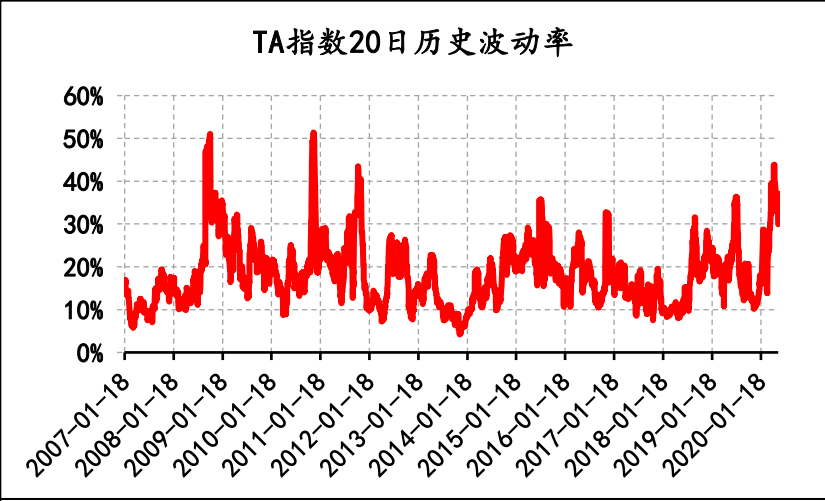
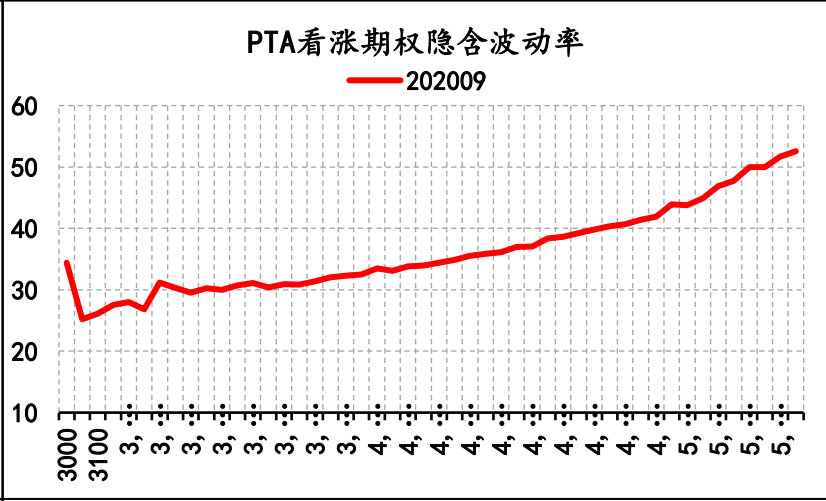
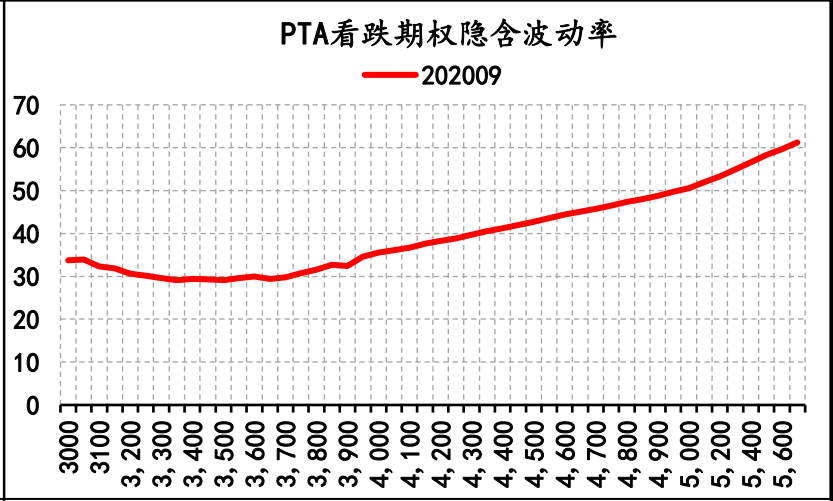
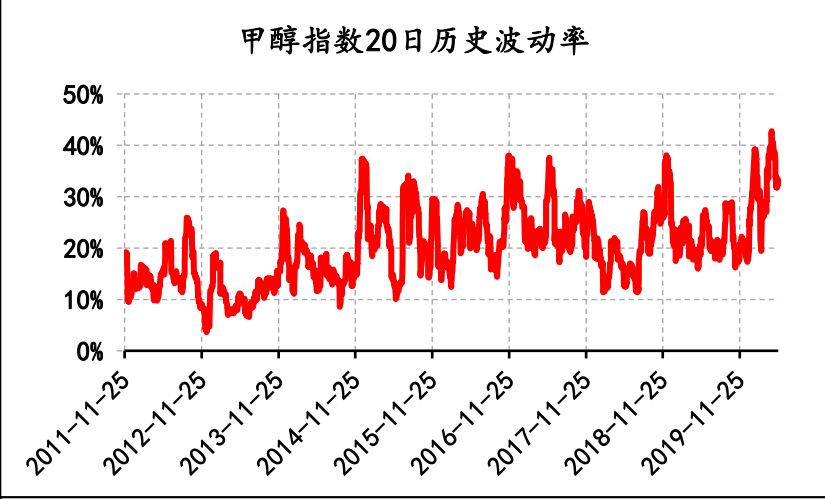
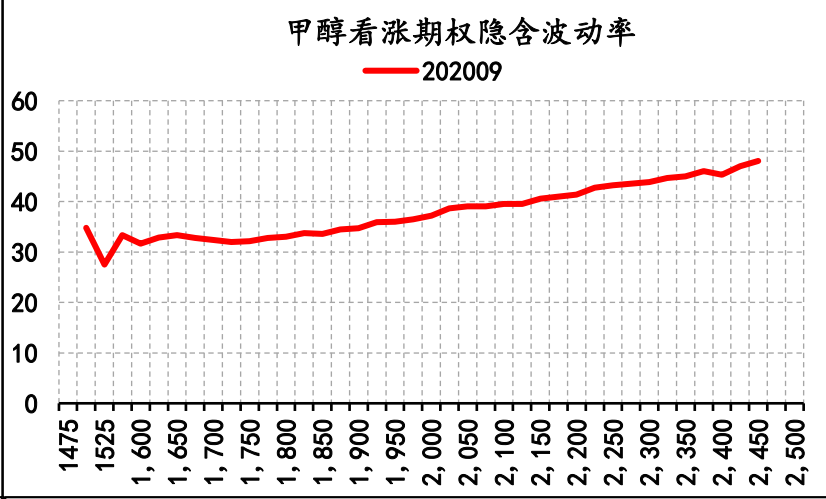
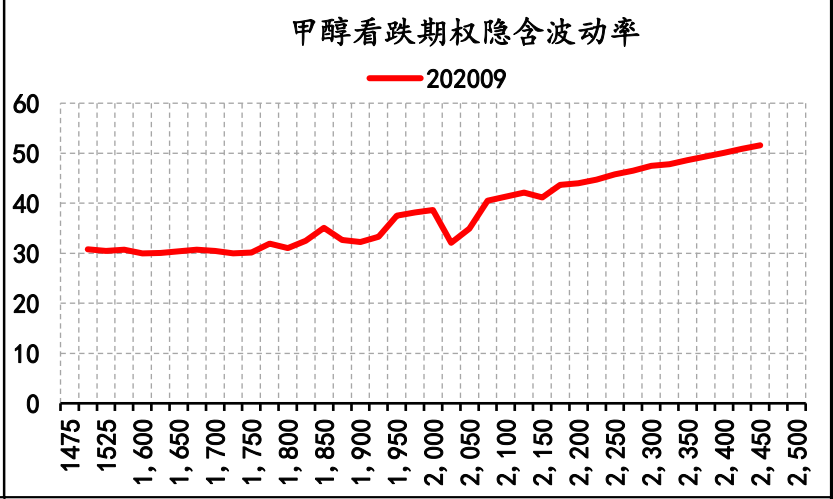
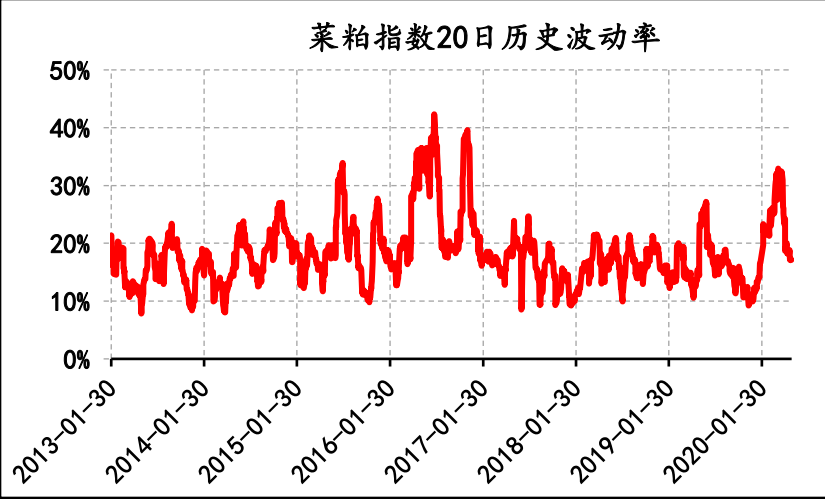
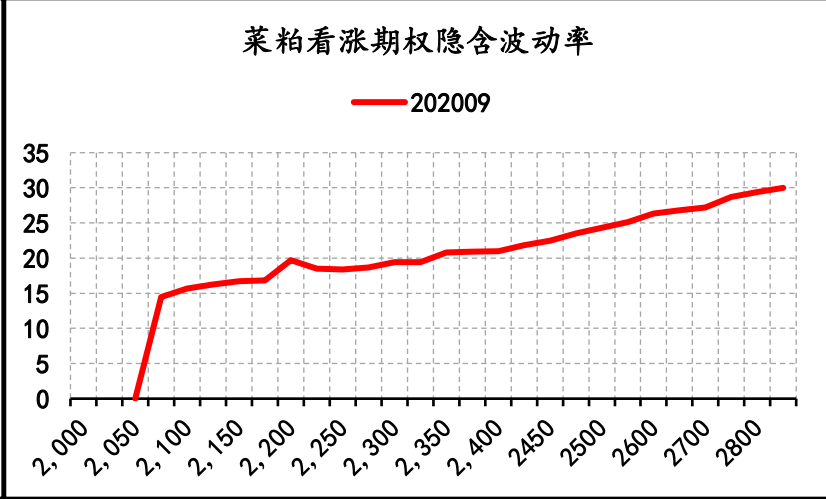
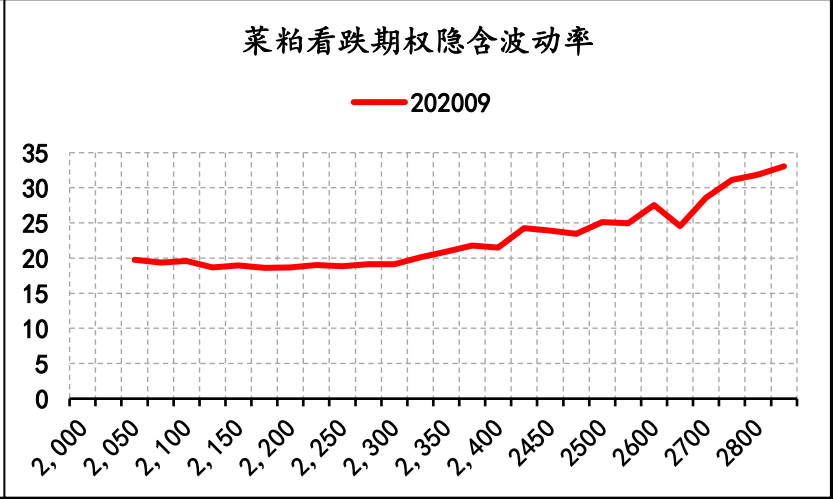


上期所期权



大商所期权



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：郭远爰（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。		