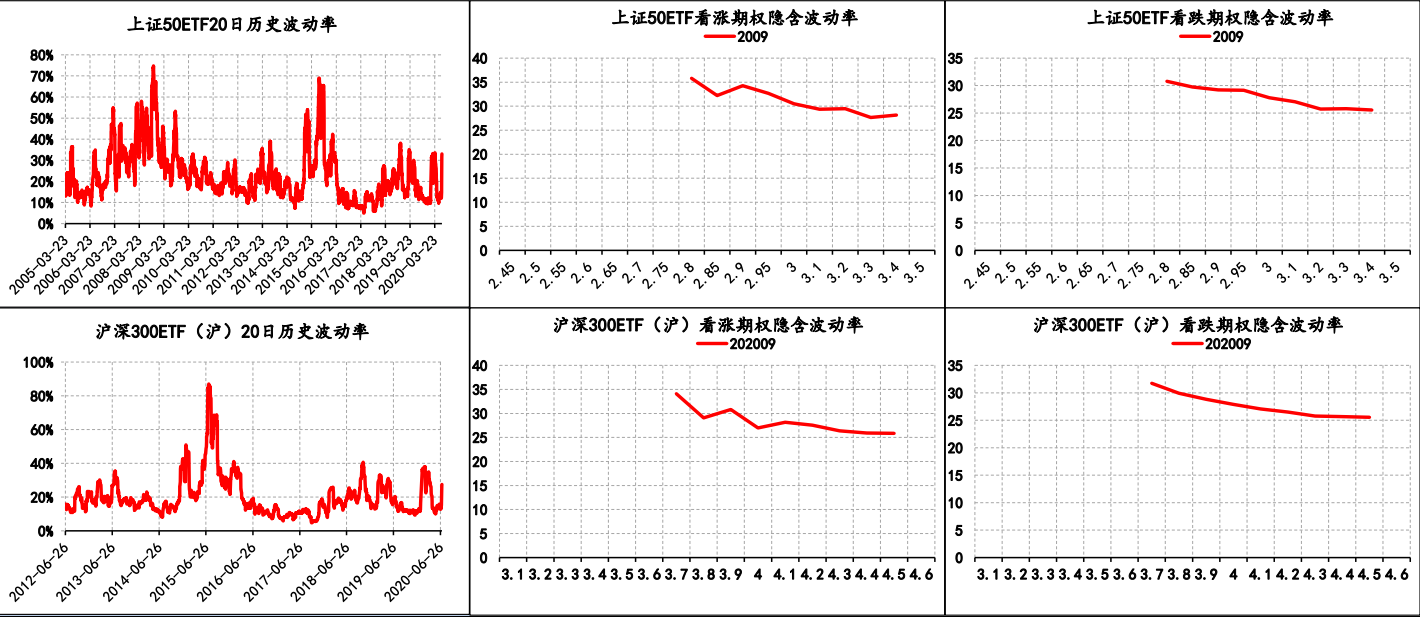


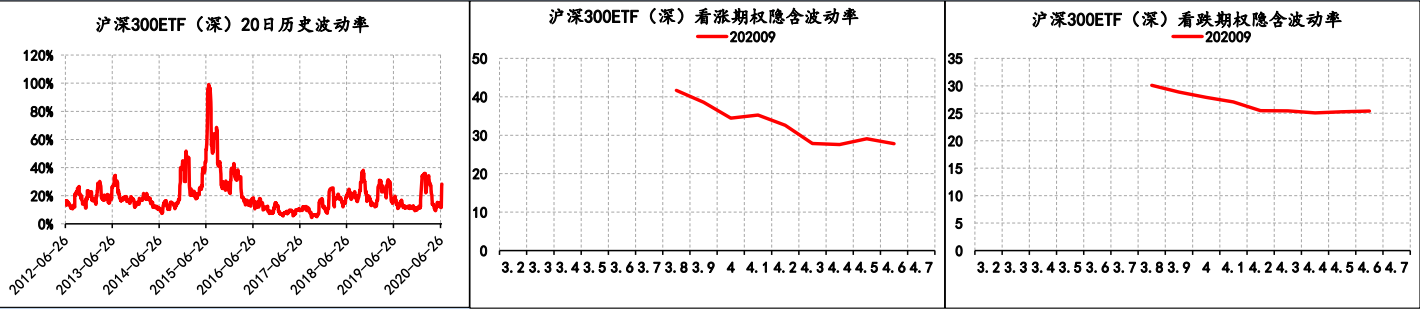
核心观点

历史波动率上升的有：50ETF、300ETF（沪）（深）、沪金、豆粕、铁矿、PTA、甲醇
历史波动率下降的有：沪深300、沪铜、沪胶、玉米、白糖、棉花、菜粕
看涨期权隐波显著高于看跌期权的有：50ETF、
看跌期权隐波显著高于看涨期权的有：沪深300指数

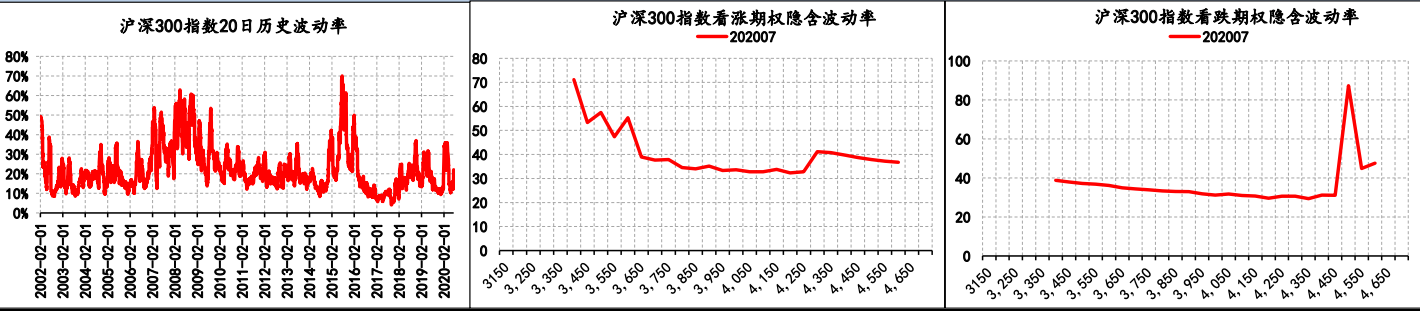
上交所期权

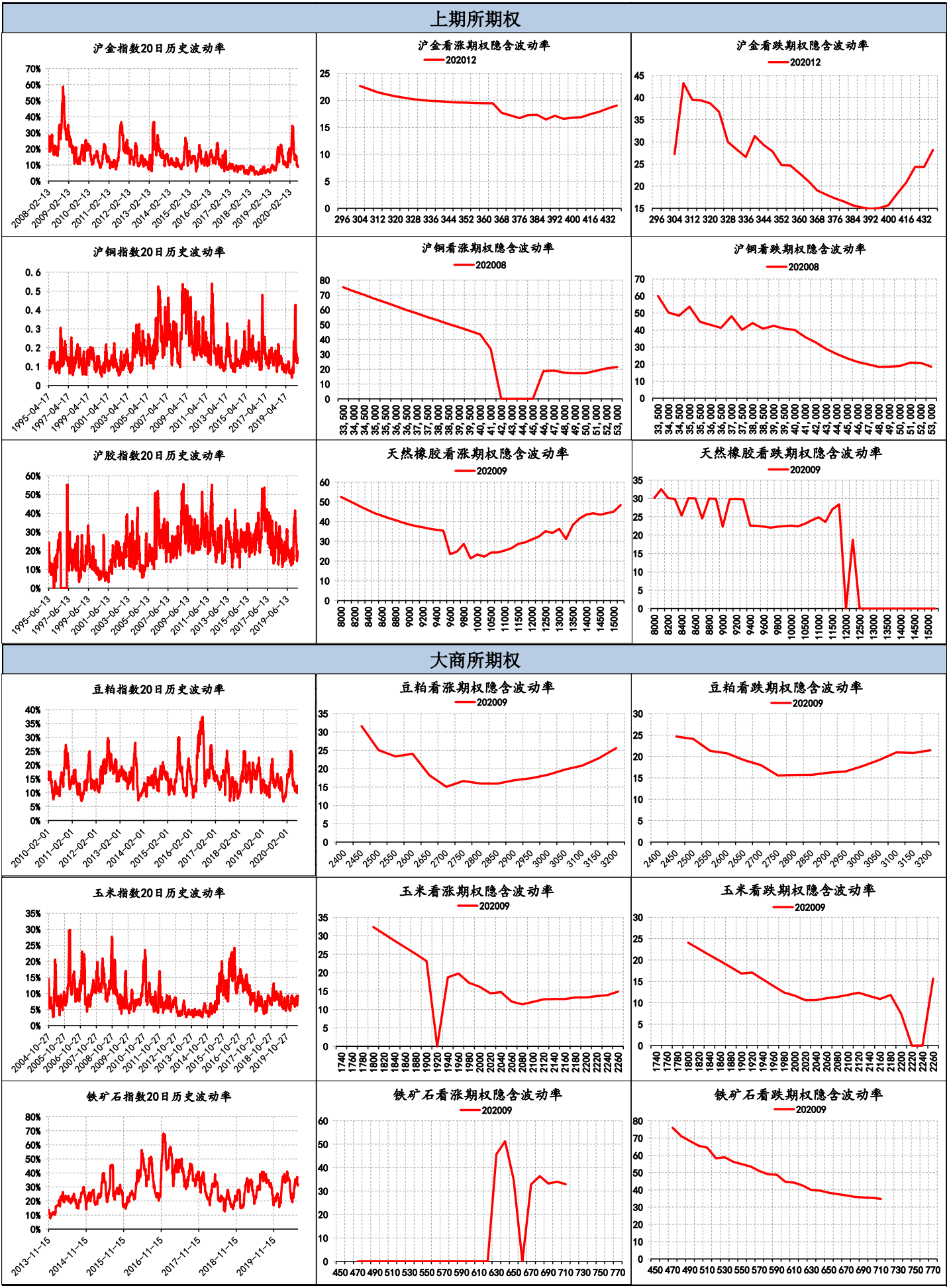


深交所期权



中金所期权





沪胶指数20日历史波动率

天然橡胶看涨期权隐含波动率

202009

天然橡胶看跌期权隐含波动率

202009

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

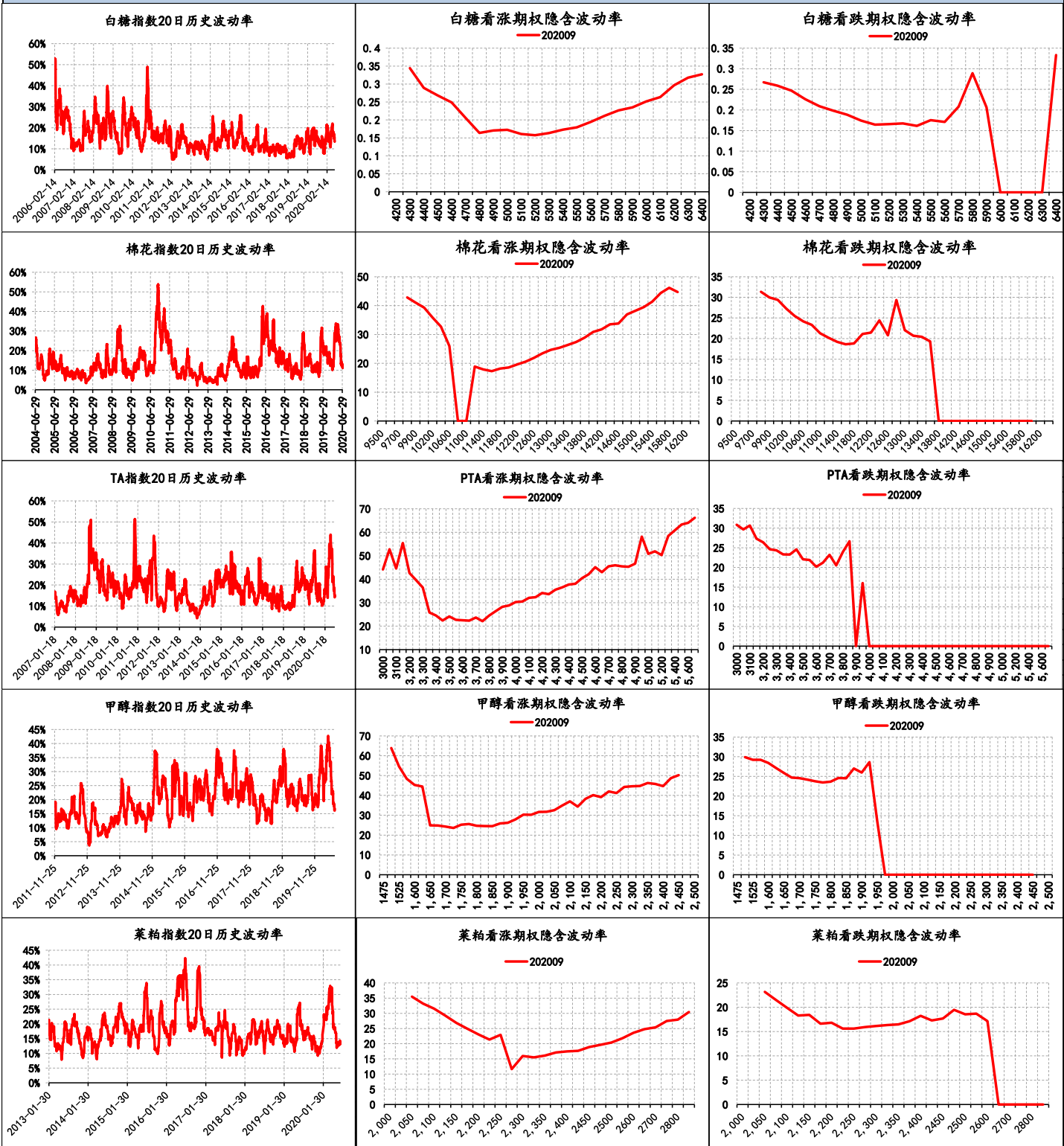
铁矿石看涨期权隐含波动率

202009

铁矿石看跌期权隐含波动率

202009

郑商所期权



 联系人：郭远葵（投资咨询资格-Z0013488） 电话：0571-28132630/18758264396 邮箱：guoyuanai@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。