



信达期货
CINDA FUTURES

期权品种历史波动率和隐含波动率跟踪2020/9/11

核心观点

历史波动率上升的有：

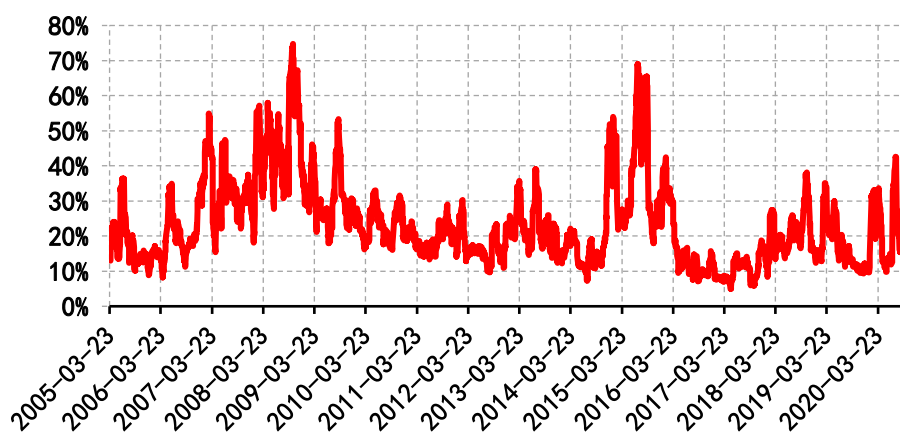
豆粕，铁矿石，PTA，甲醇，菜粕

历史波动率下降的有：

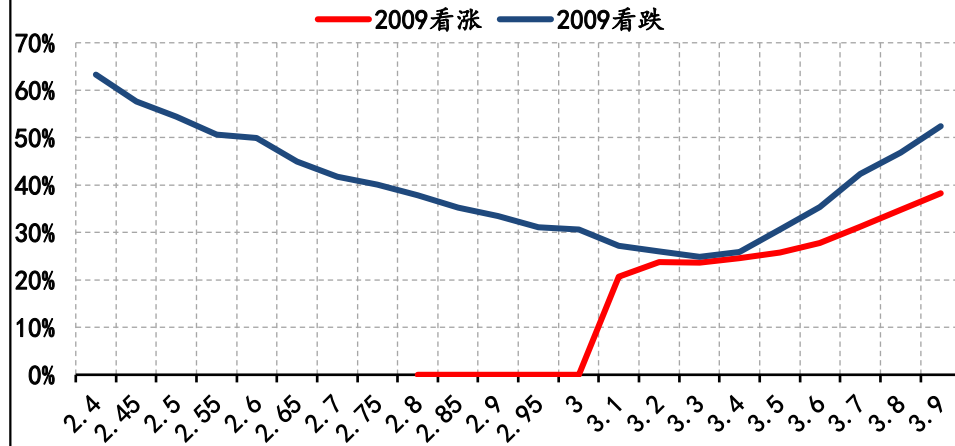
50ETF，300ETF(沪)，300ETF(深)，沪深300，铜，金，沪胶，玉米，白糖，棉花

上交所期权

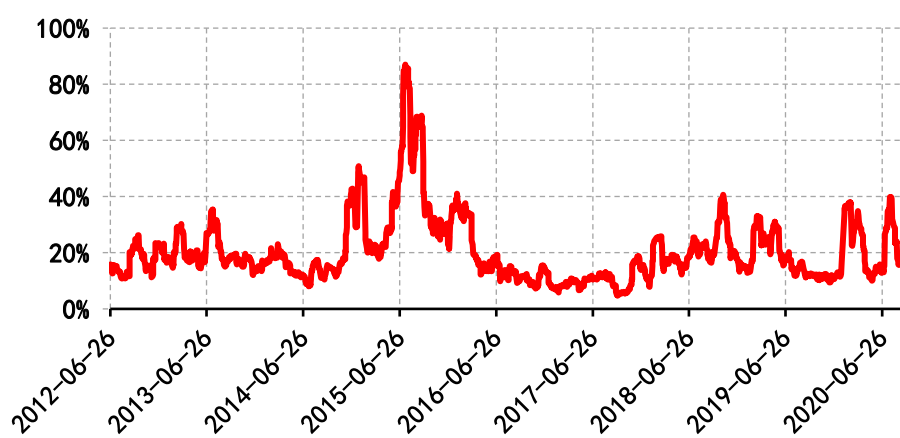
上证50ETF20日历史波动率



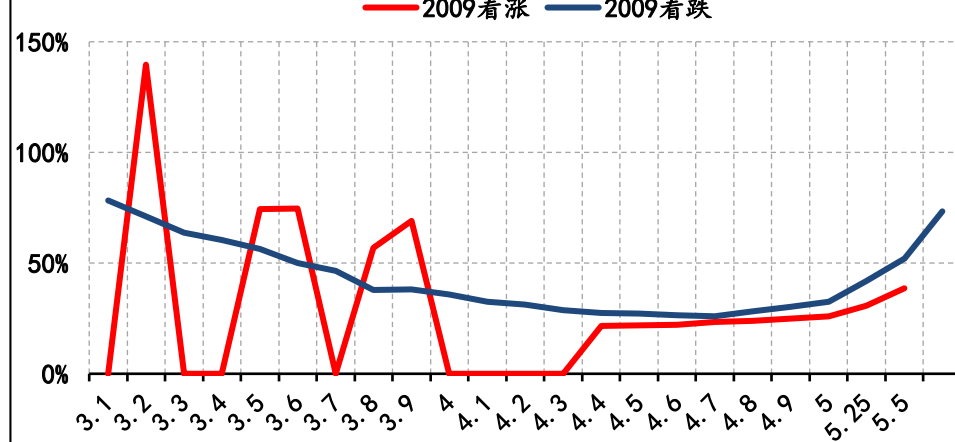
上证50ETF期权隐含波动率



沪深300ETF（沪）20日历史波动率

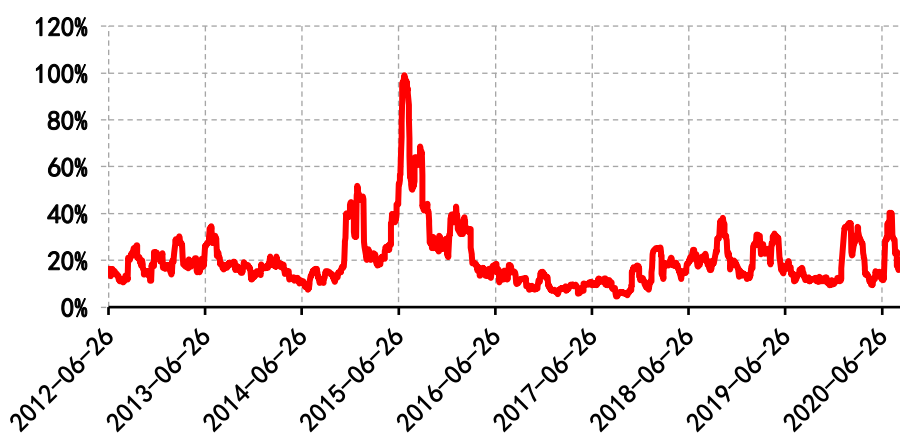


沪深300ETF（沪）期权隐含波动率

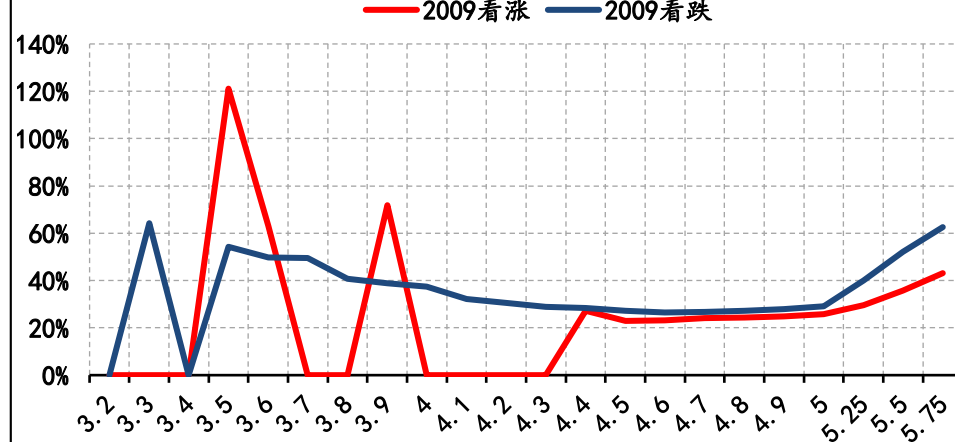


深交所期权

沪深300ETF（深）20日历史波动率

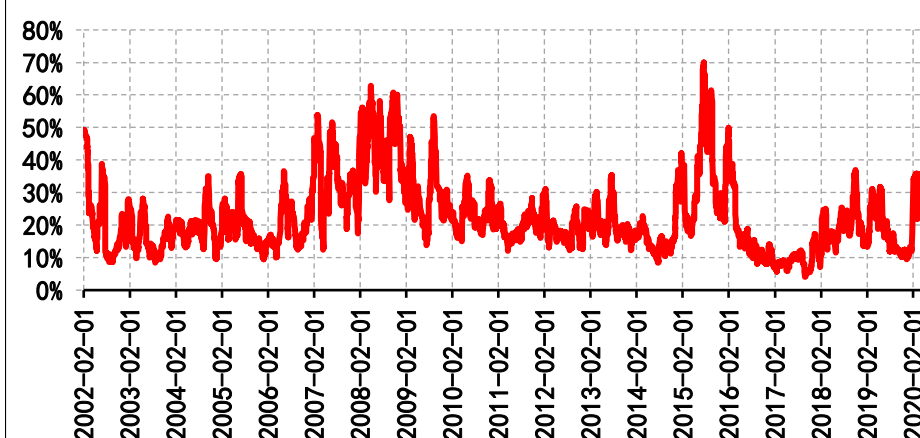


沪深300ETF（深）期权隐含波动率

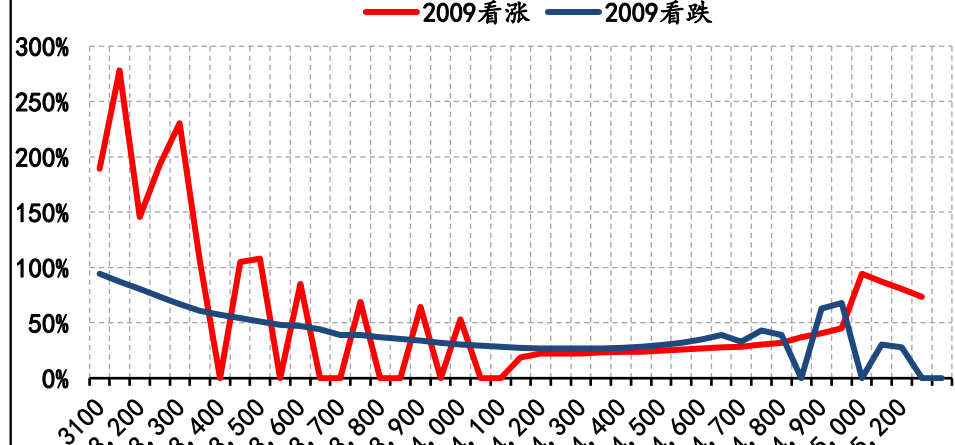


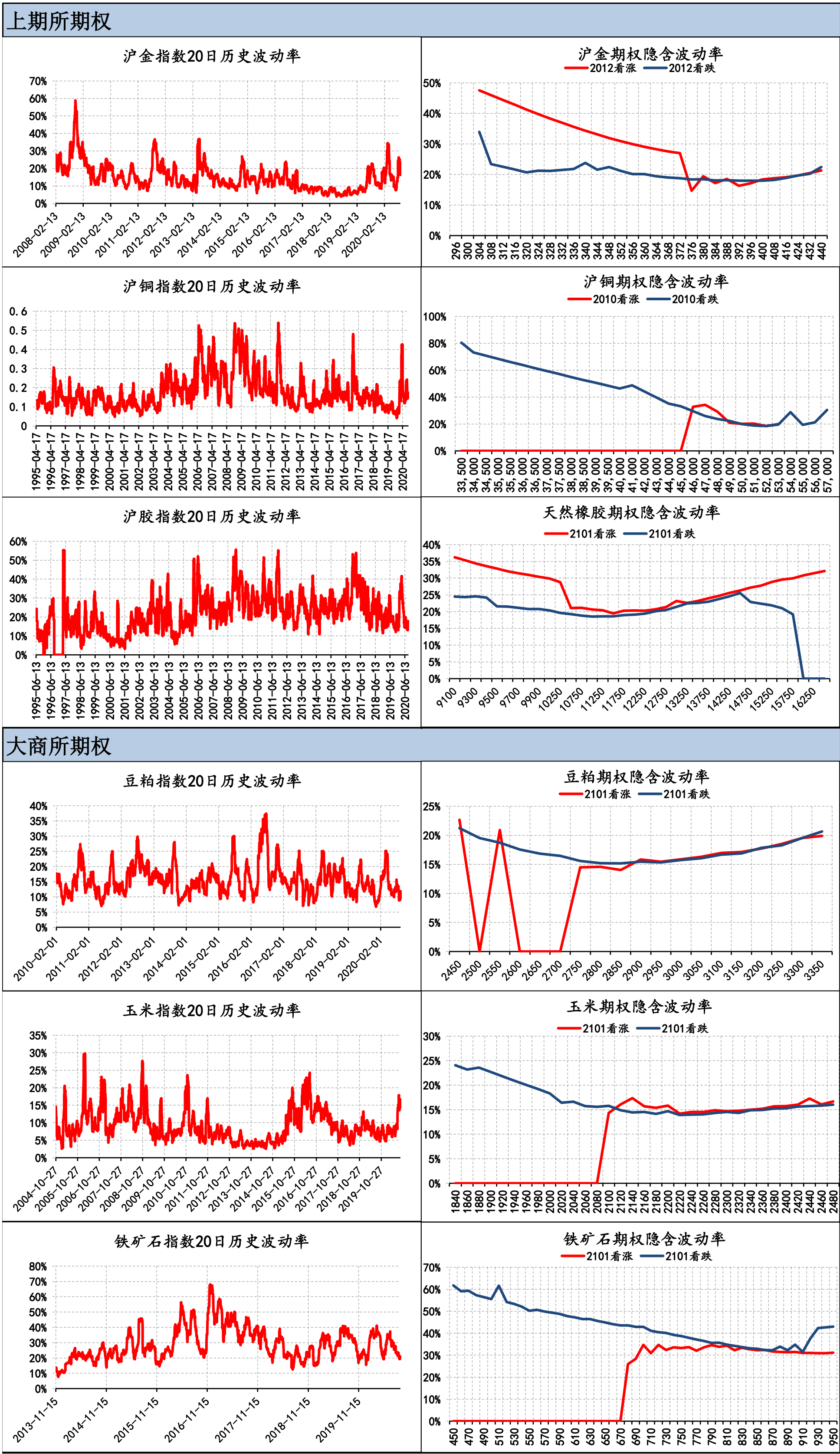
中金所期权

沪深300指数20日历史波动率



沪深300指数期权隐含波动率





沪胶指数20日历史波动率

天然橡胶期权隐含波动率

大商所期权

豆粕指数20日历史波动率

豆粕期权隐含波动率

玉米指数20日历史波动率

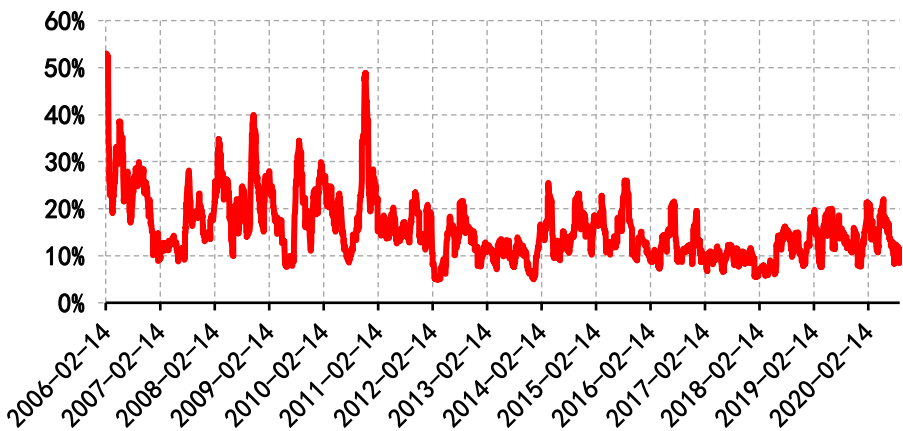
玉米期权隐含波动率

铁矿石指数20日历史波动率

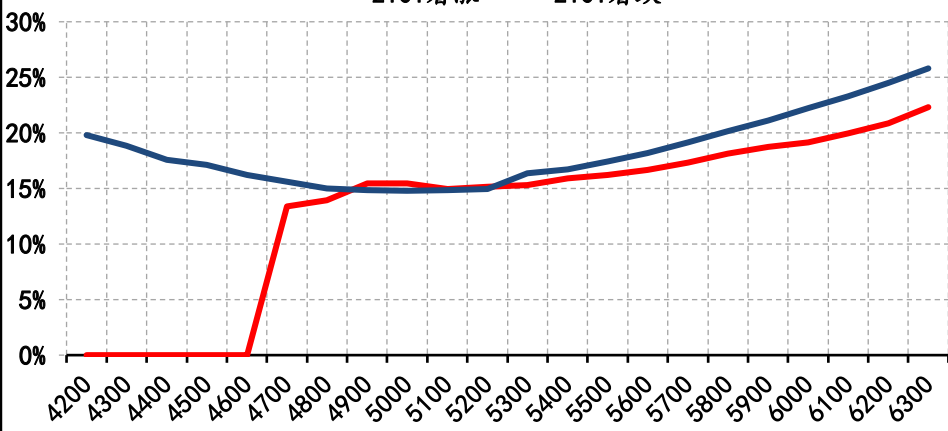
铁矿石期权隐含波动率

郑商所期权

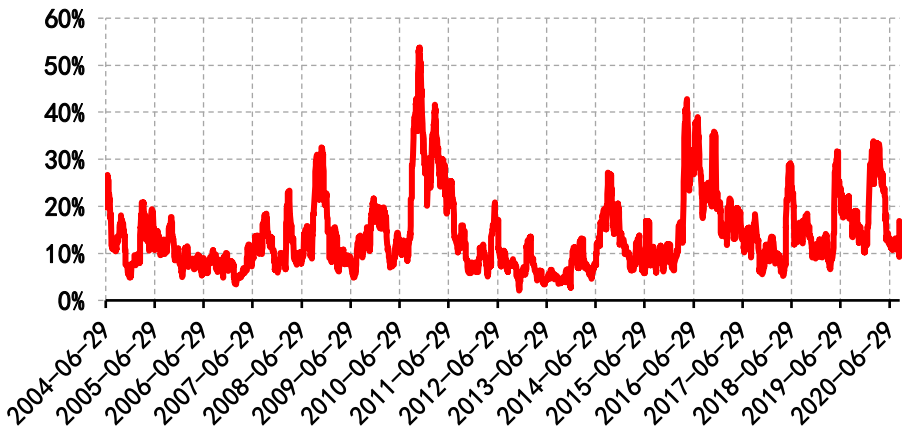
白糖指数20日历史波动率



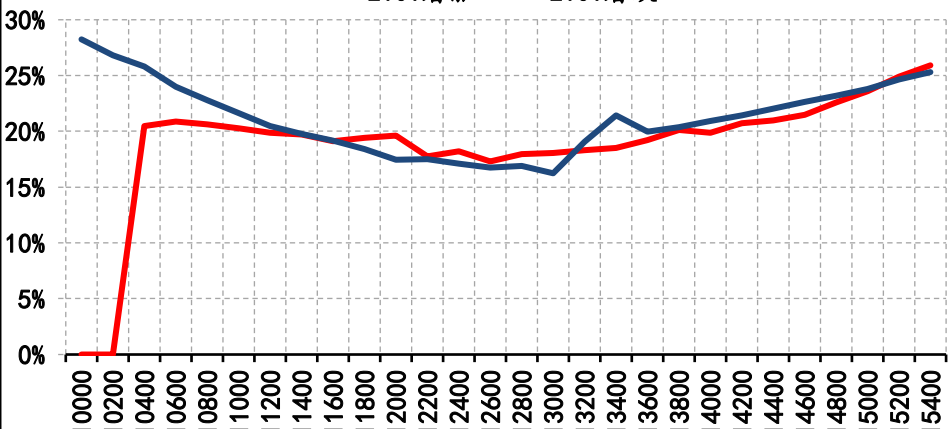
白糖期权隐含波动率



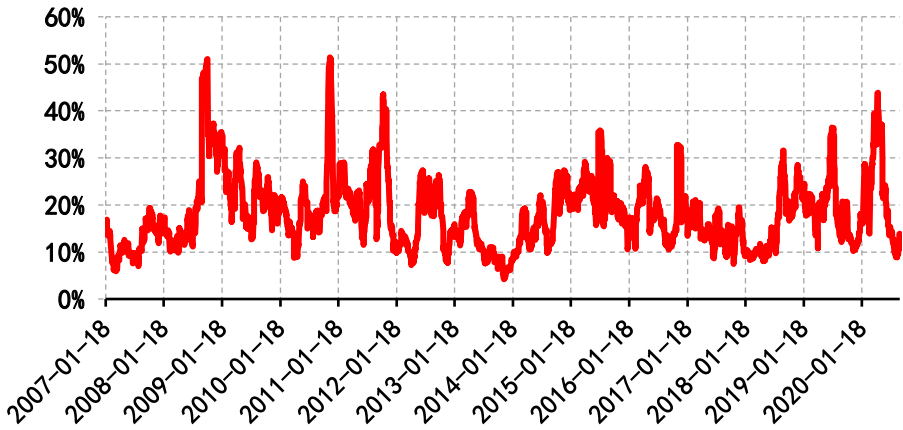
棉花指数20日历史波动率



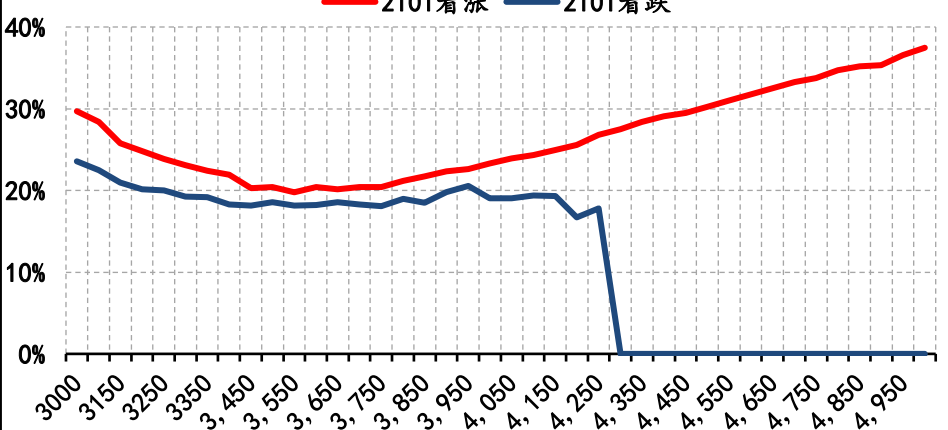
棉花期权隐含波动率



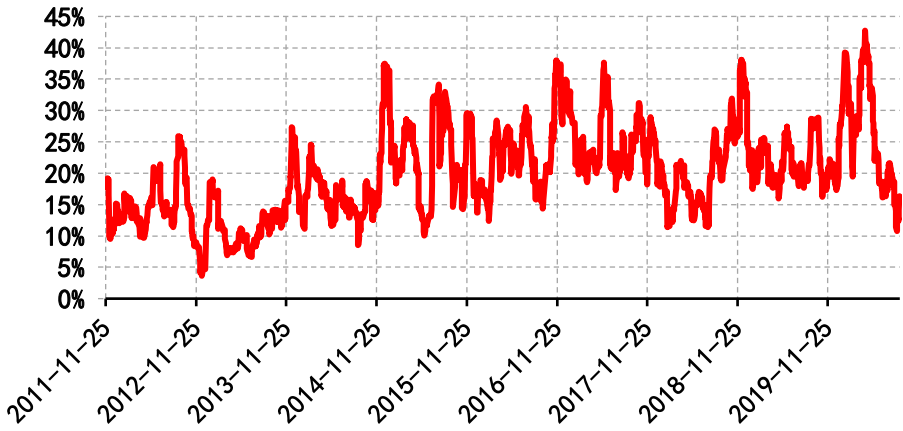
PTA指数20日历史波动率



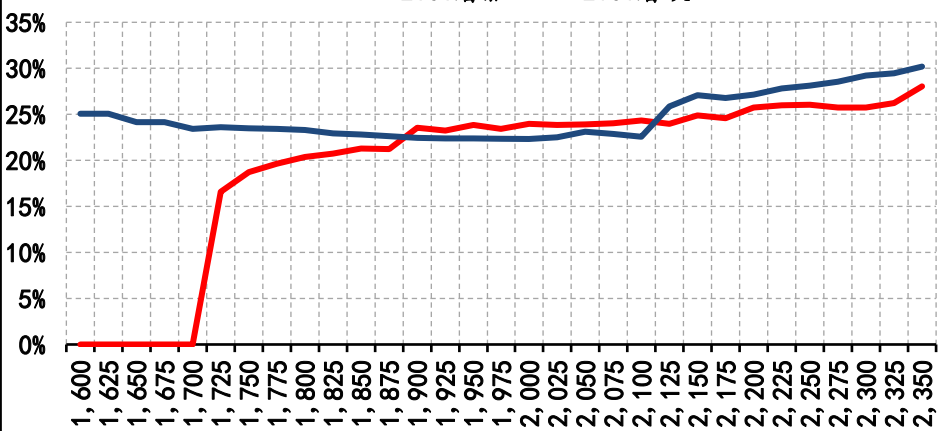
PTA期权隐含波动率



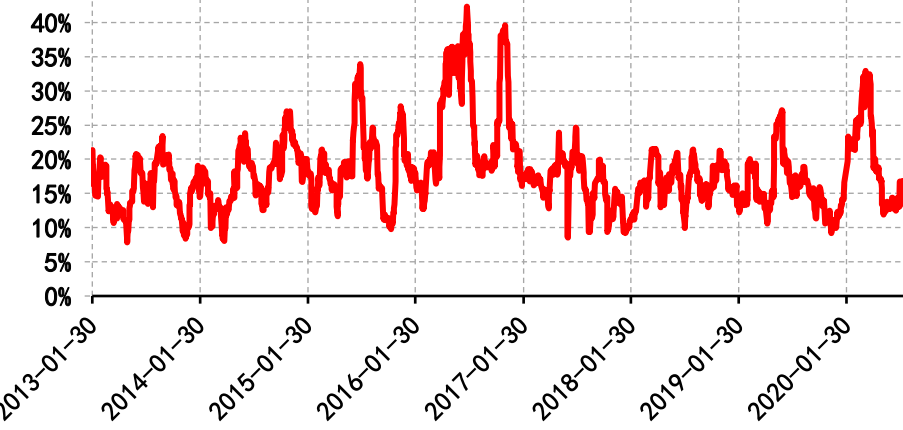
甲醇指数20日历史波动率



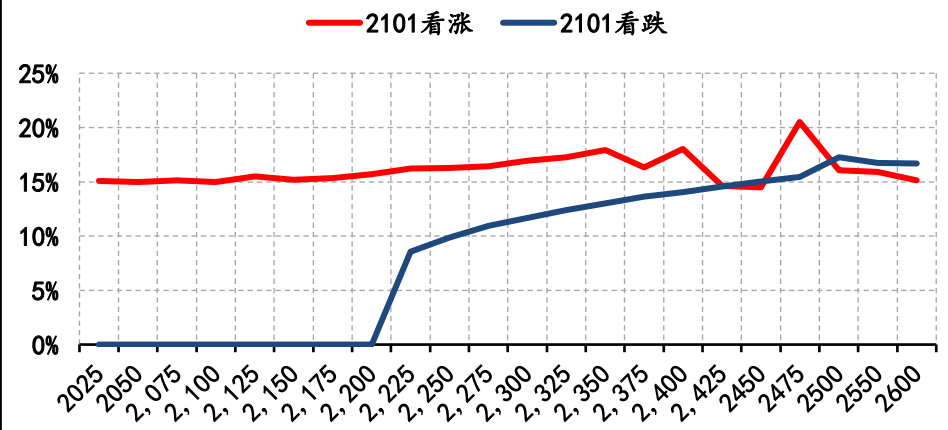
甲醇期权隐含波动率



莱粕指数20日历史波动率



莱粕期权隐含波动率



联系人：张秀峰（投资咨询资格-Z0011152）
电话：0571-28132619
邮箱：zhangxiufeng@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。