

核心观点

历史波动率上升的有：

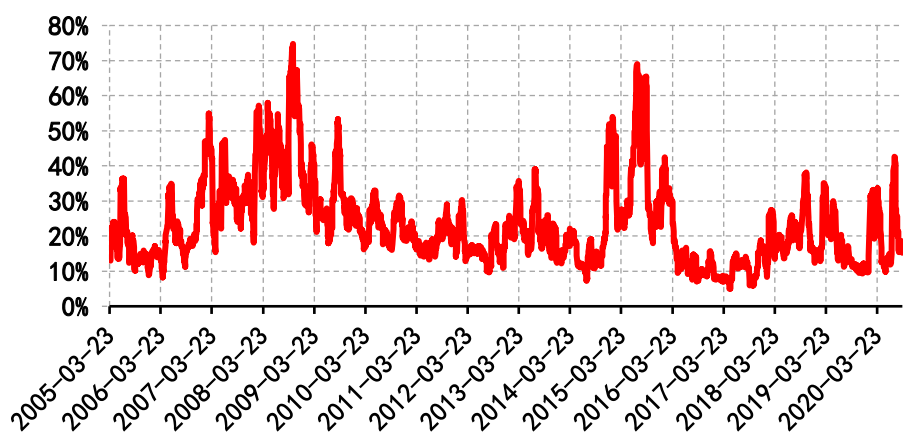
50ETF，300ETF(沪)，300ETF(深)，沪深300，铜，金，沪胶，豆粕，玉米，铁矿石，白糖，PTA，甲醇，菜粕

历史波动率下降的有：

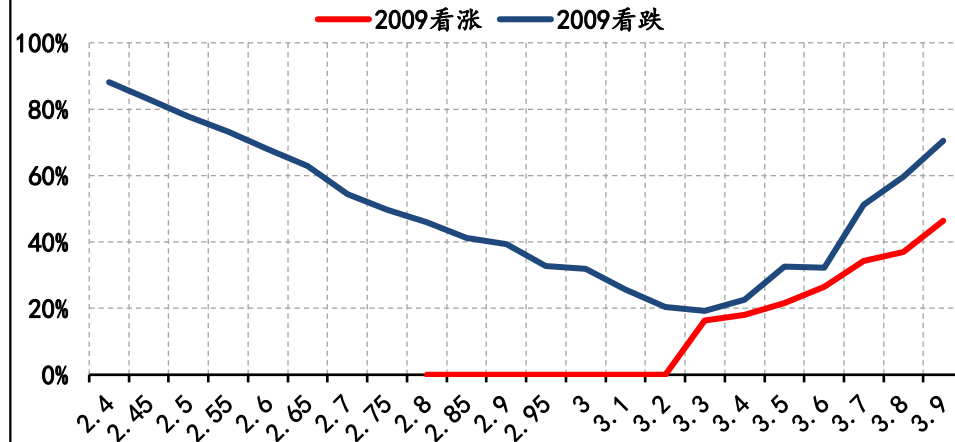
棉花

上交所期权

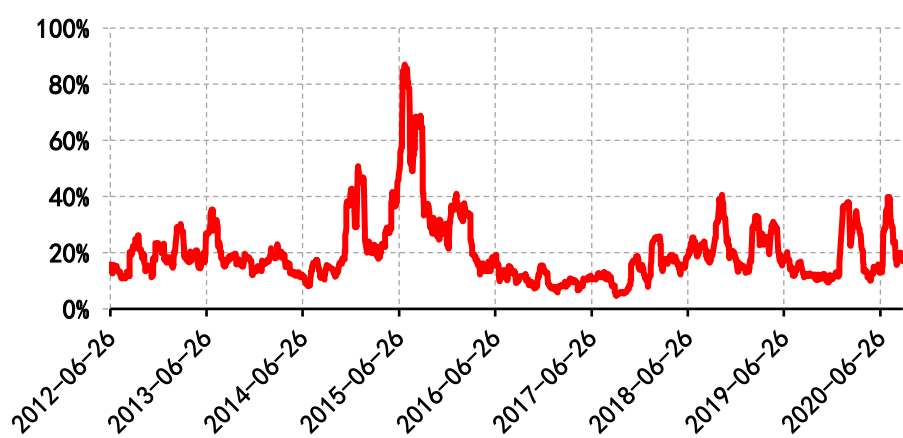
上证50ETF20日历史波动率



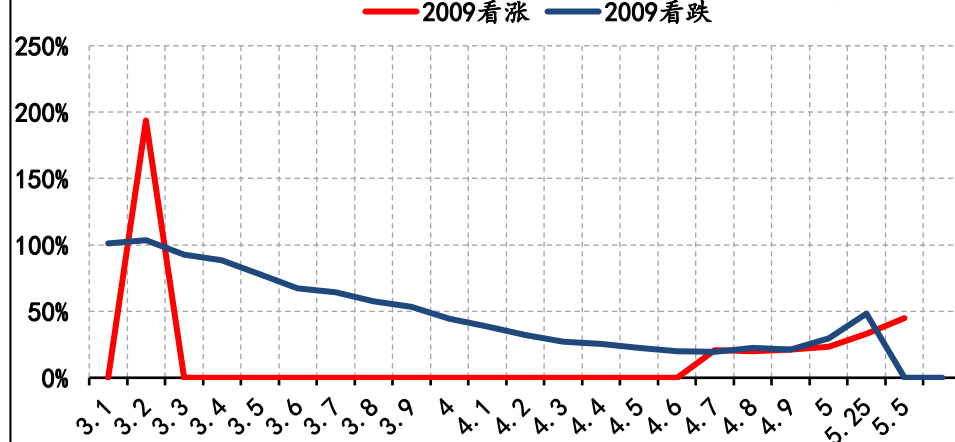
上证50ETF期权隐含波动率



沪深300ETF（沪）20日历史波动率

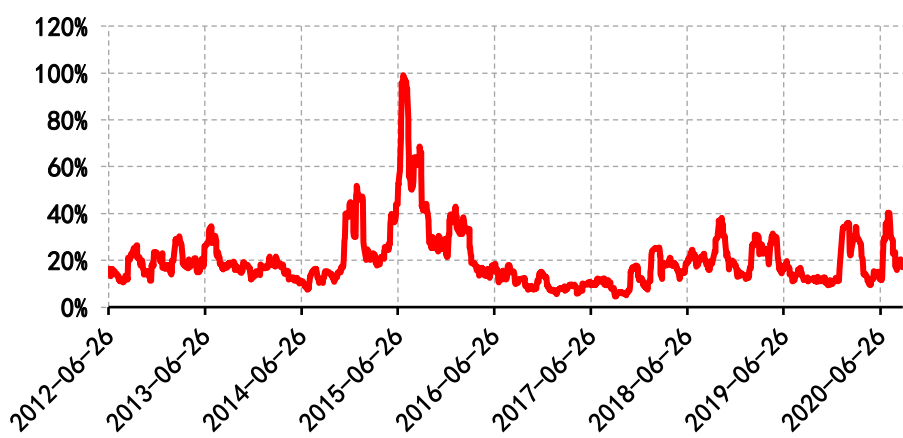


沪深300ETF（沪）期权隐含波动率

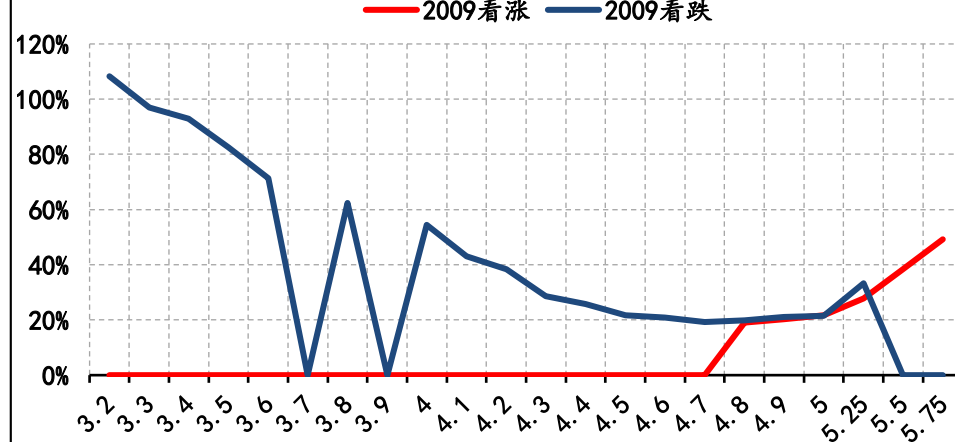


深交所期权

沪深300ETF（深）20日历史波动率

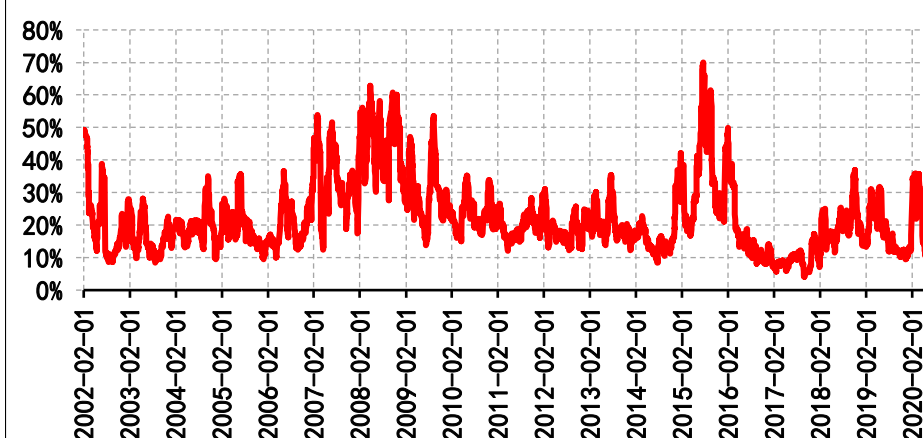


沪深300ETF（深）期权隐含波动率

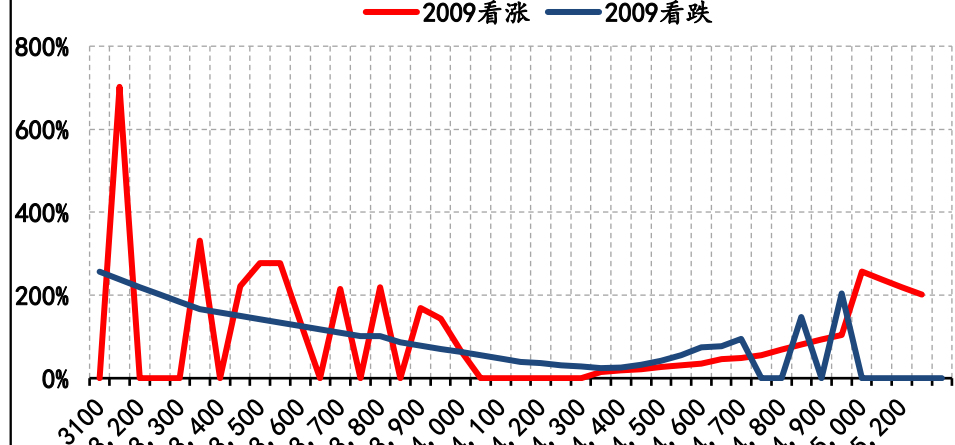


中金所期权

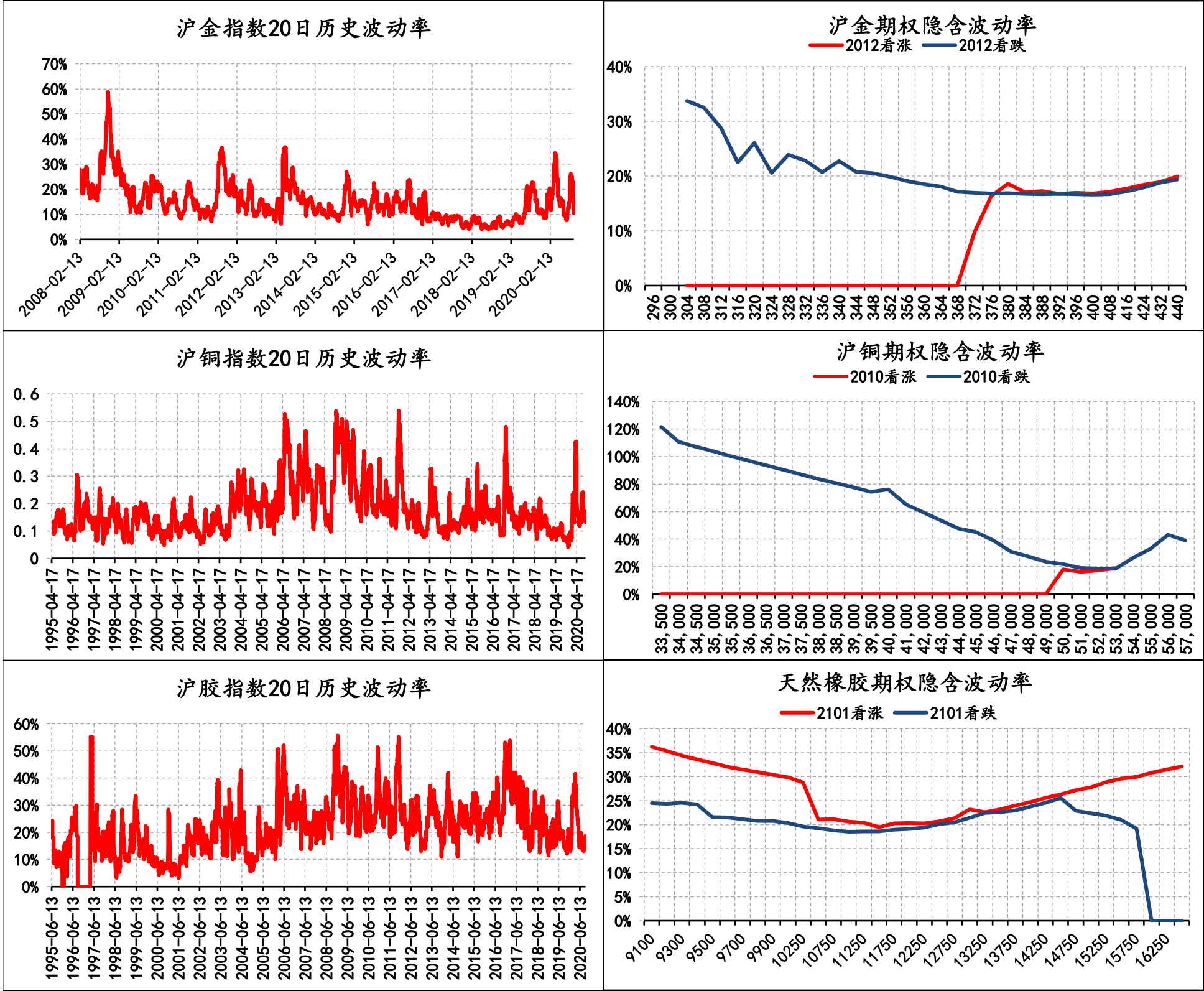
沪深300指数20日历史波动率



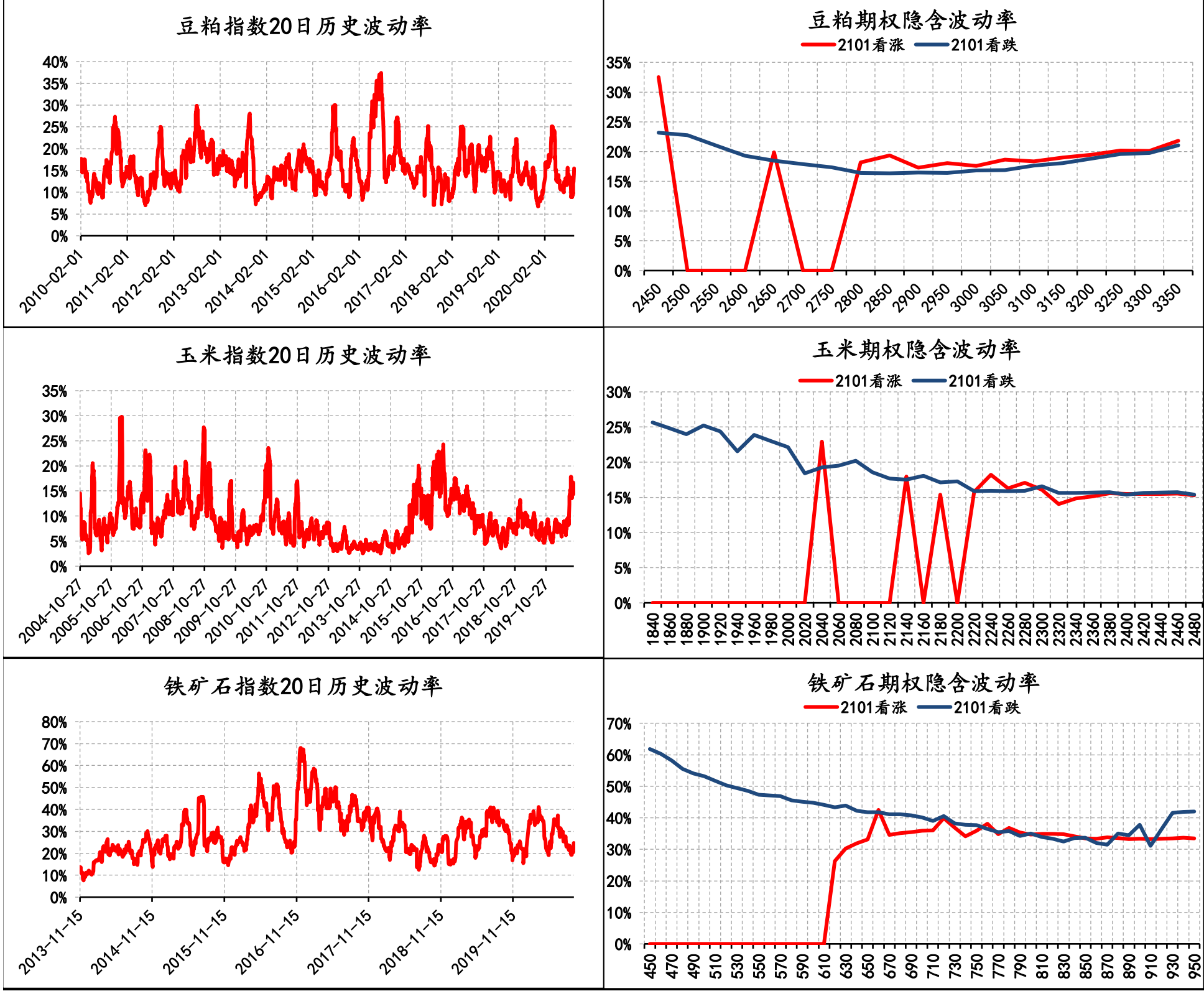
沪深300指数期权隐含波动率



上期所期权

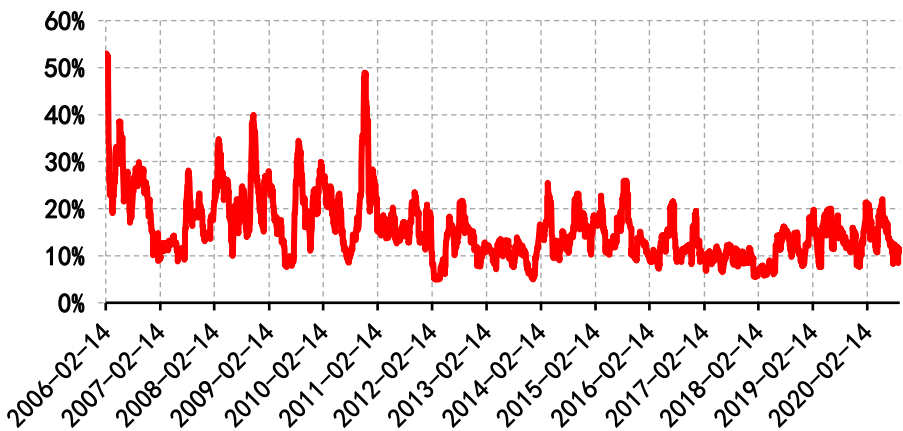


大商所期权



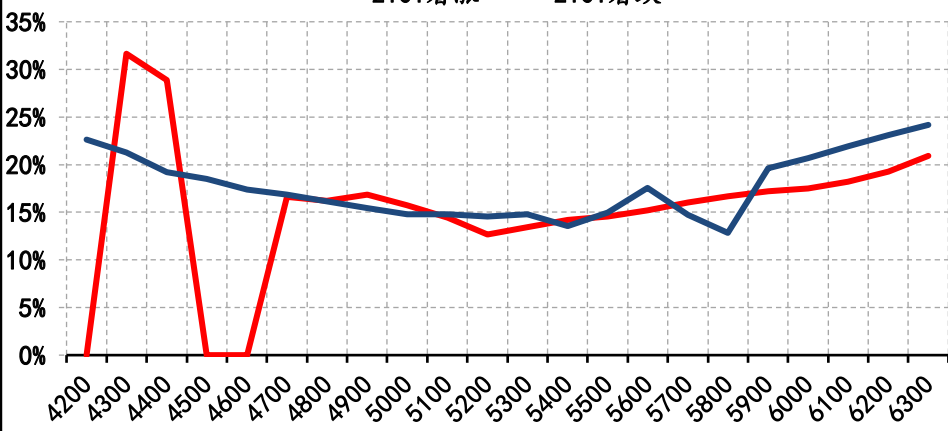
郑商所期权

白糖指数20日历史波动率

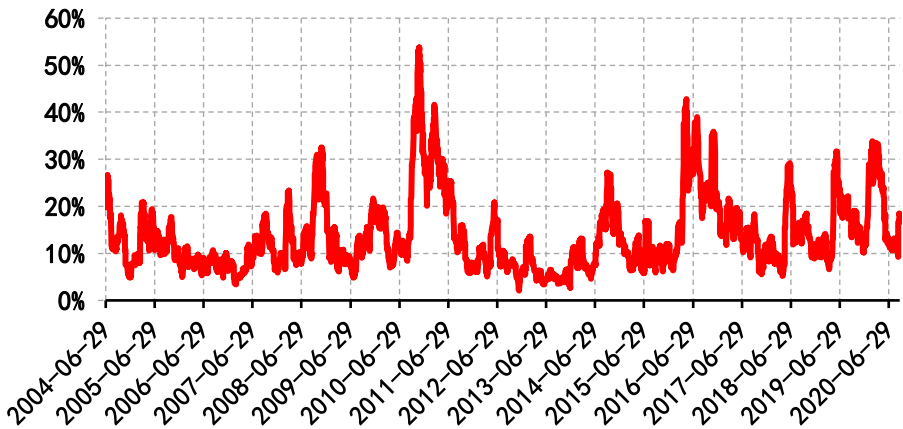


白糖期权隐含波动率

— 2101看涨 — 2101看跌

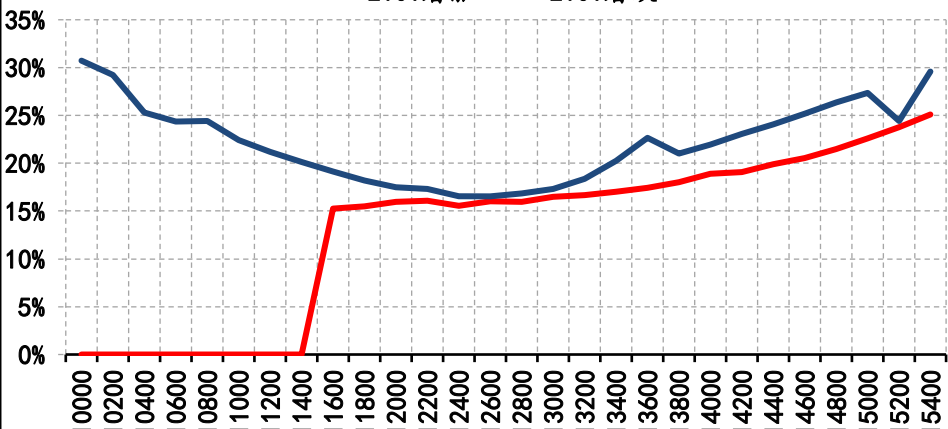


棉花指数20日历史波动率

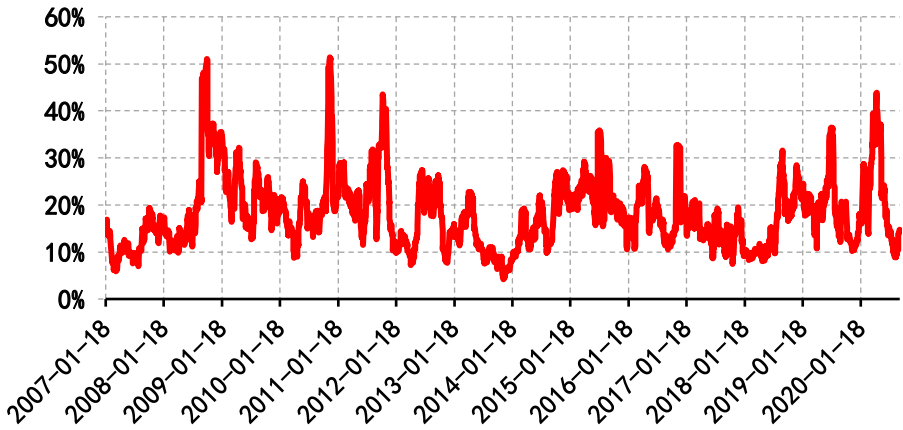


棉花期权隐含波动率

— 2101看涨 — 2101看跌

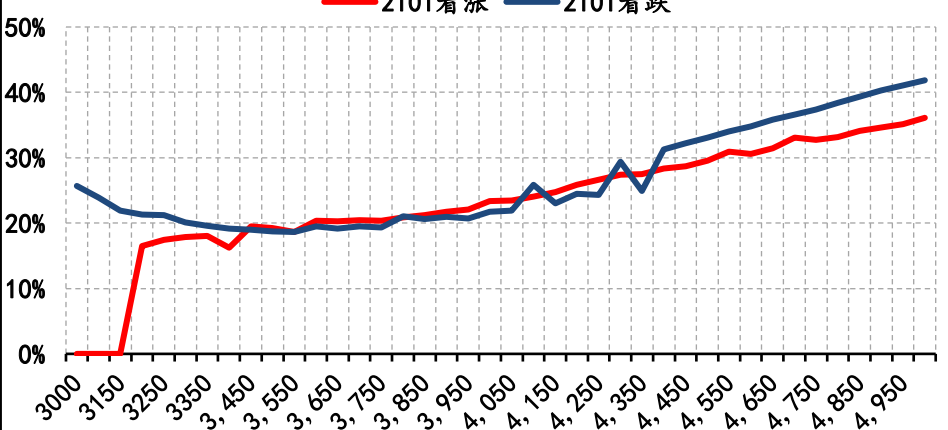


PTA指数20日历史波动率

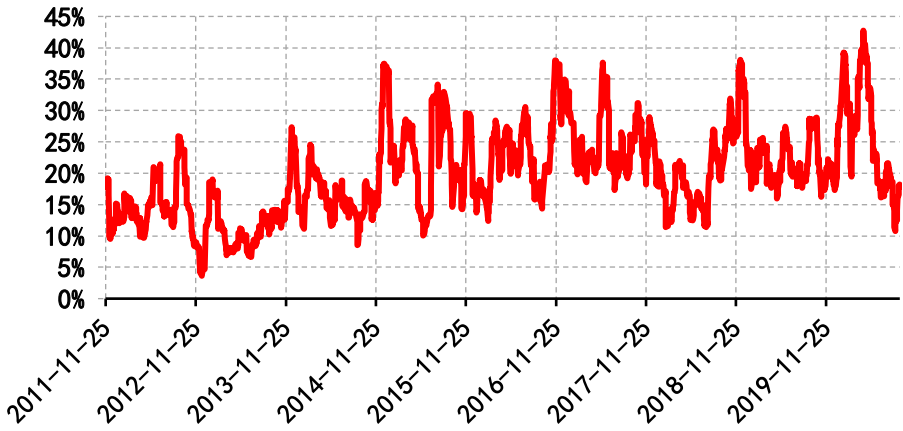


PTA期权隐含波动率

— 2101看涨 — 2101看跌

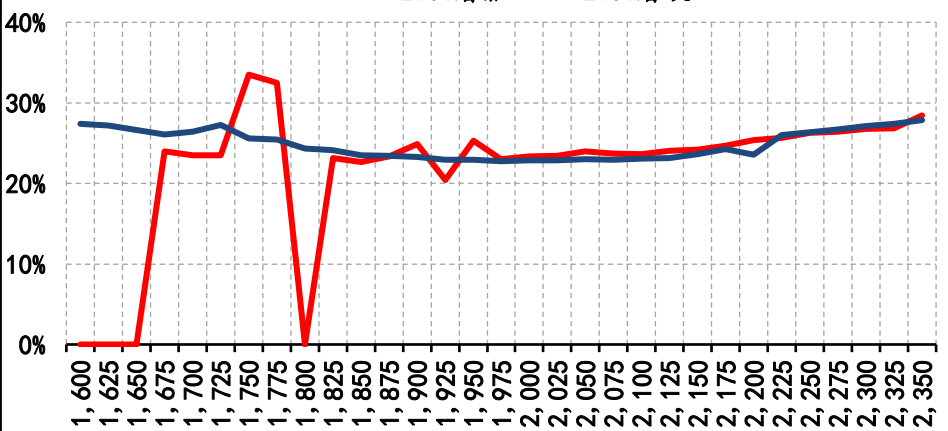


甲醇指数20日历史波动率

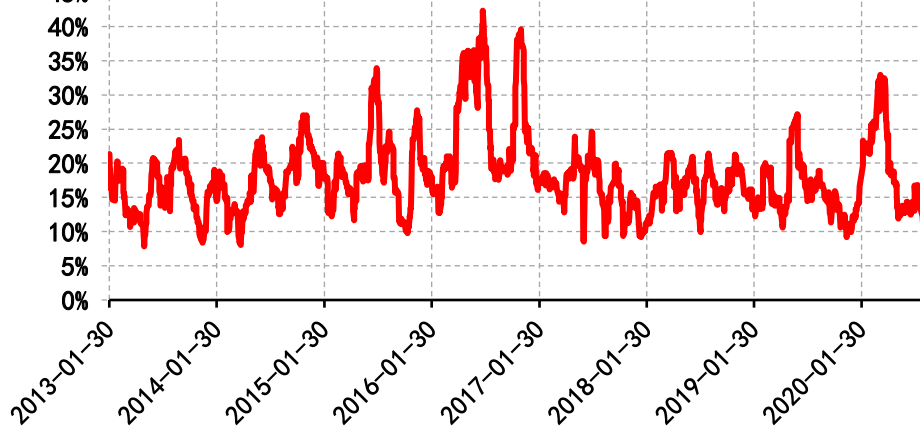


甲醇期权隐含波动率

— 2101看涨 — 2101看跌

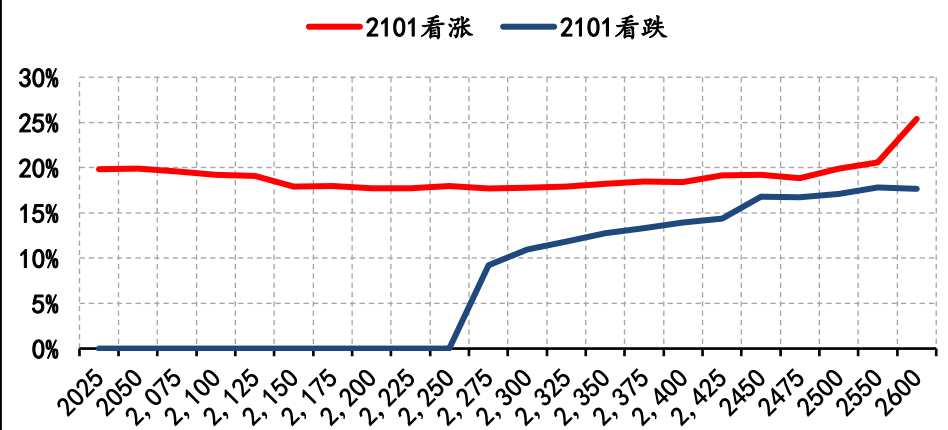


莱粕指数20日历史波动率



莱粕期权隐含波动率

— 2101看涨 — 2101看跌



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。