

核心观点

历史波动率上升的有：

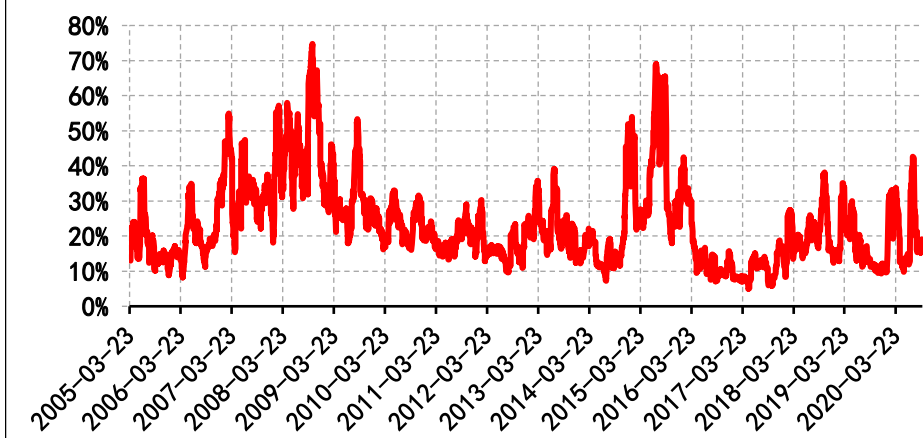
铜，沪胶，玉米，铁矿石，白糖，棉花，PTA，菜粕

历史波动率下降的有：

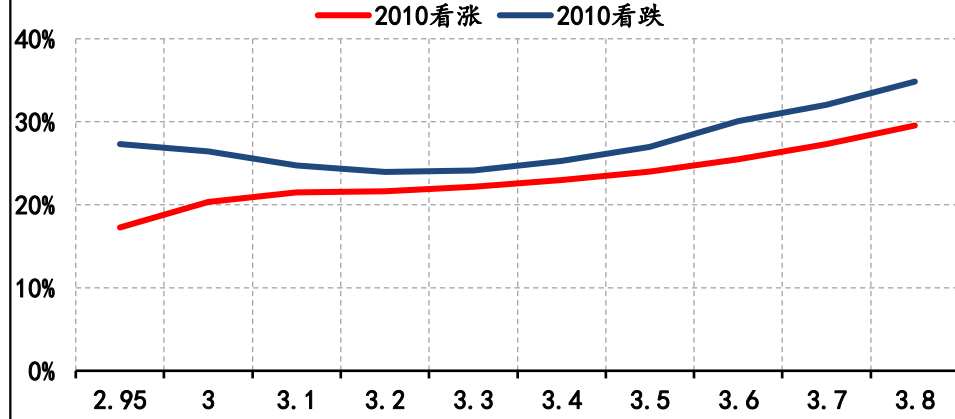
50ETF，300ETF（沪），300ETF（深），沪深300，金，豆粕，甲醇

上交所期权

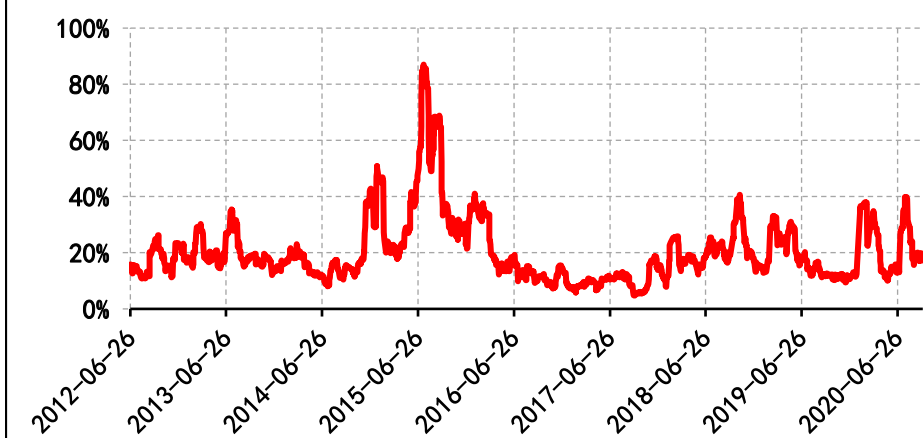
上证50ETF20日历史波动率



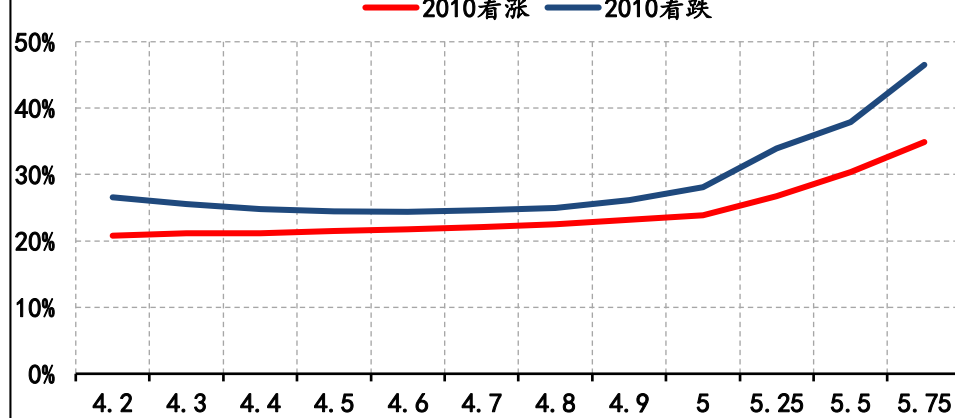
上证50ETF期权隐含波动率



沪深300ETF（沪）20日历史波动率

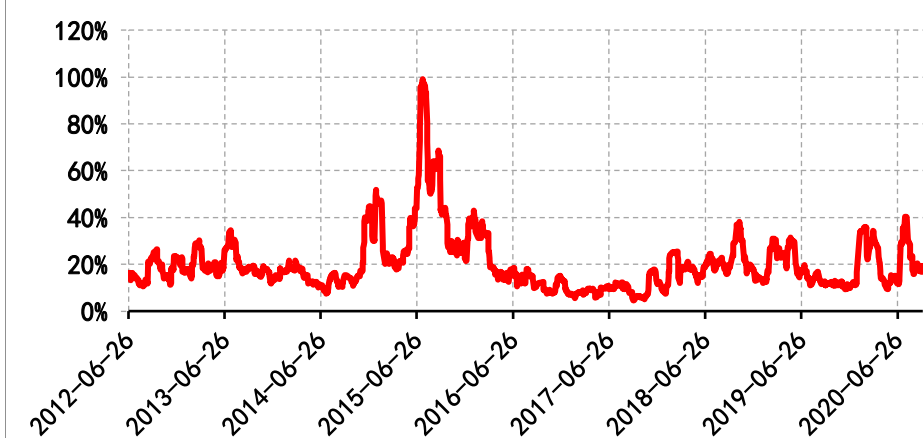


沪深300ETF（沪）期权隐含波动率

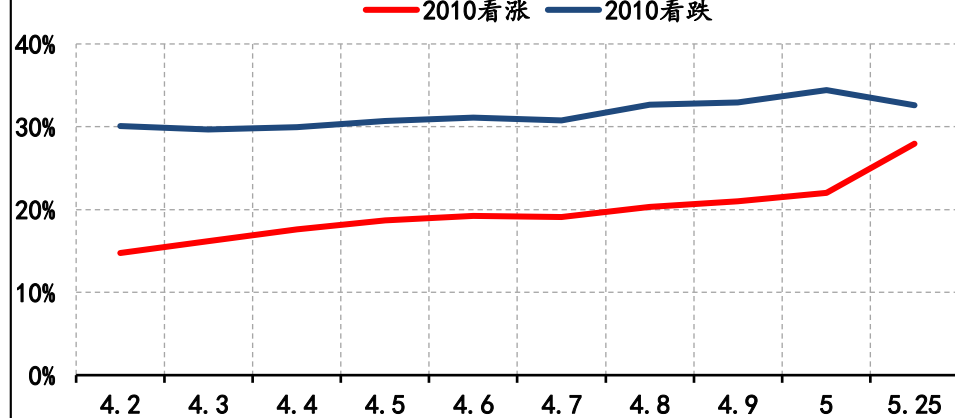


深交所期权

沪深300ETF（深）20日历史波动率

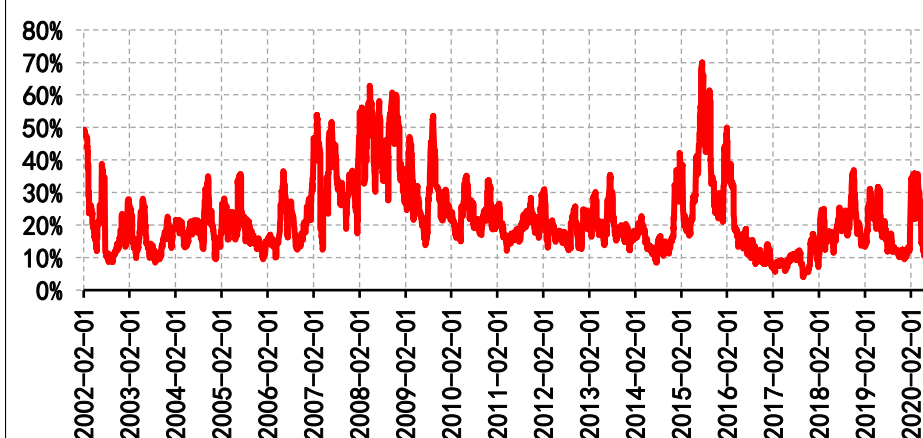


沪深300ETF（深）期权隐含波动率

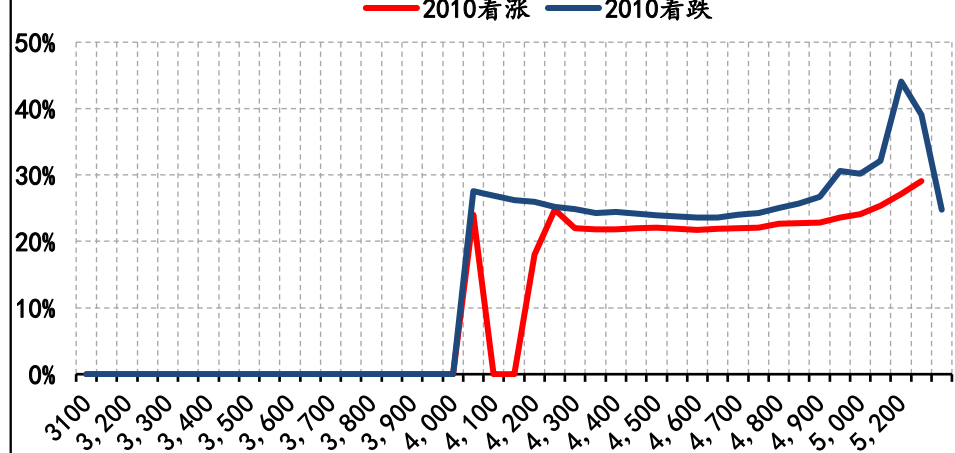


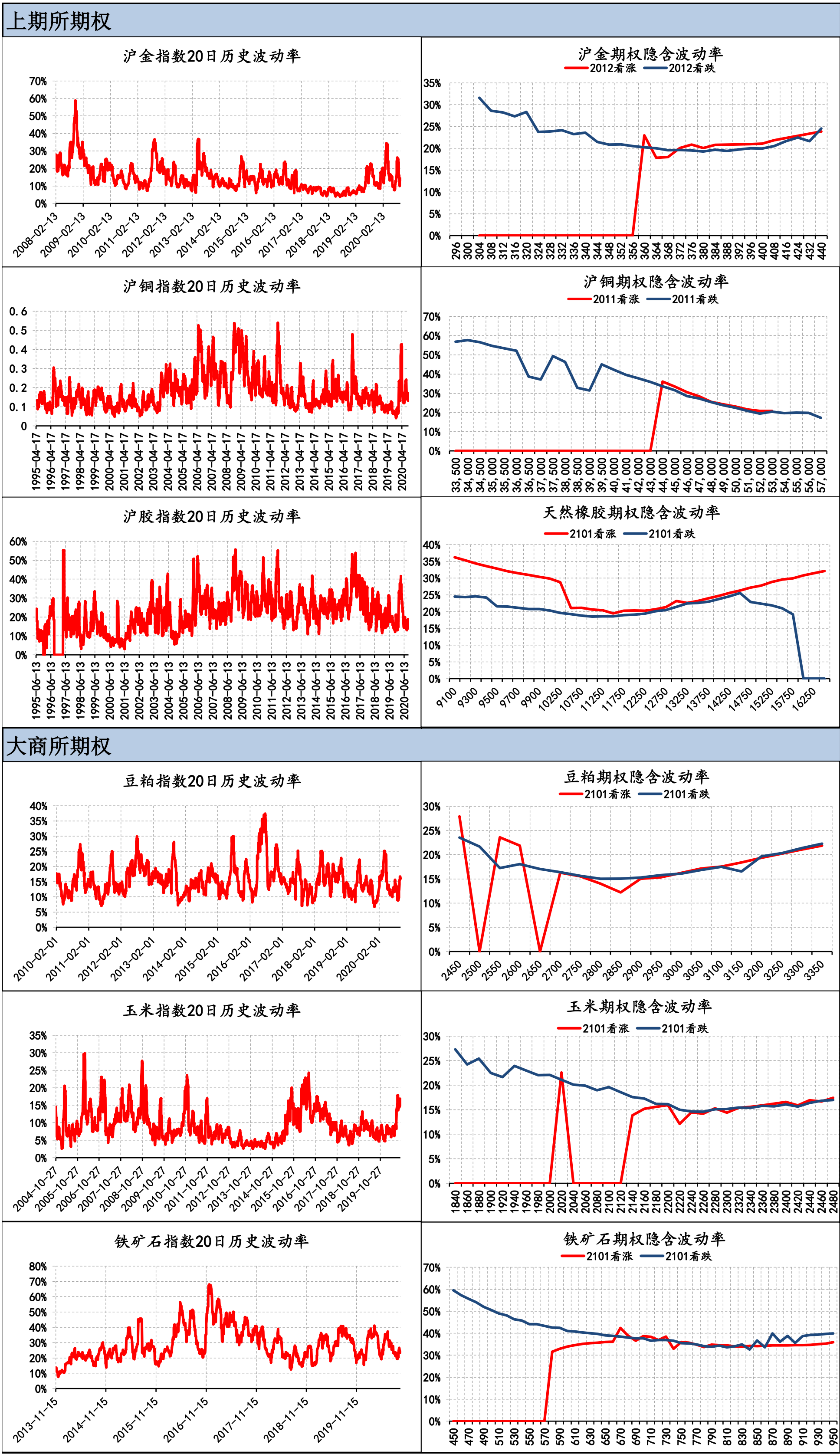
中金所期权

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

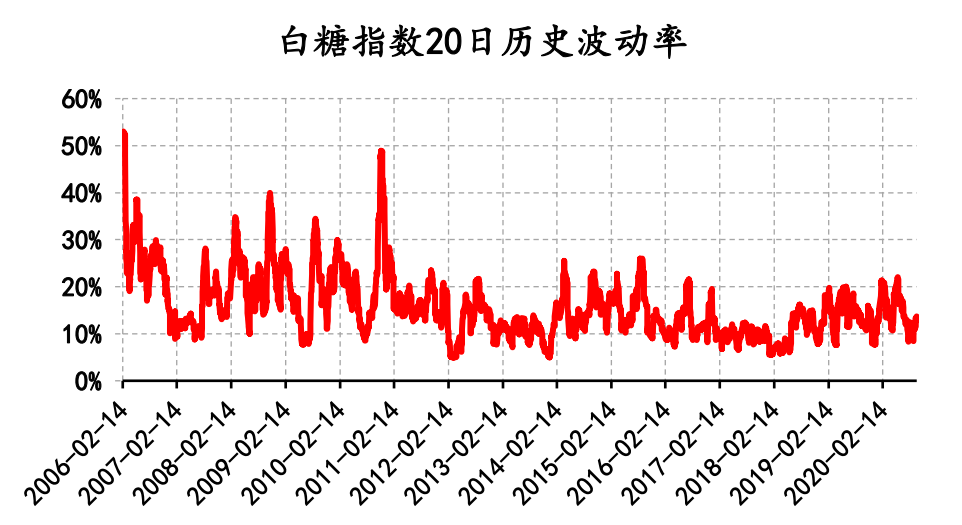
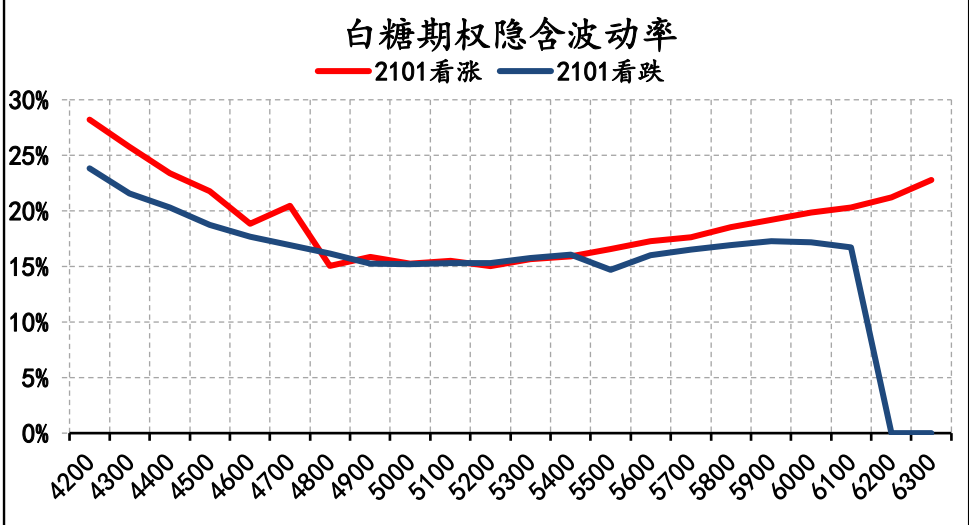
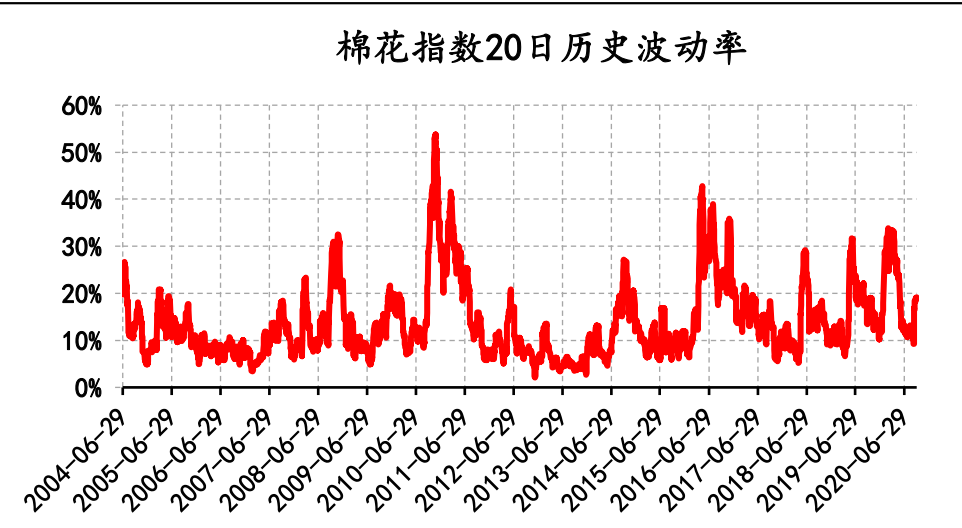
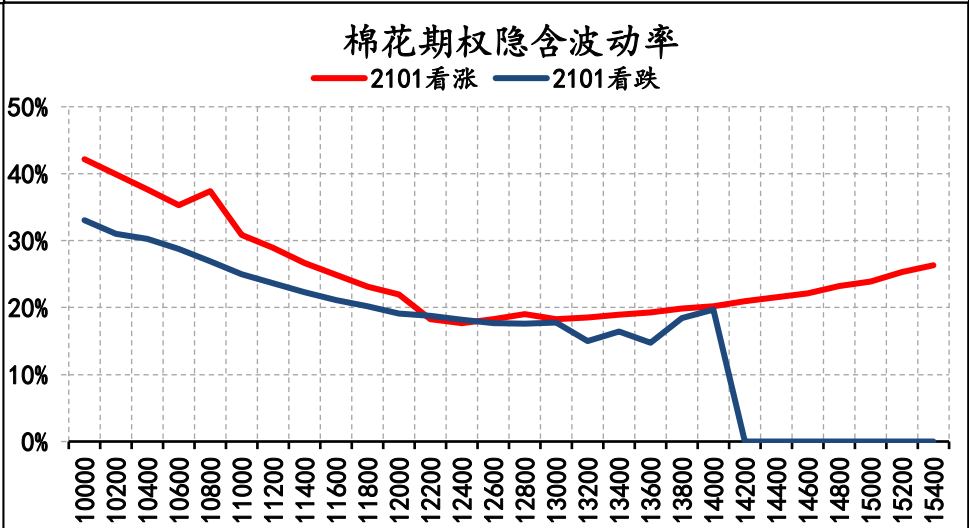
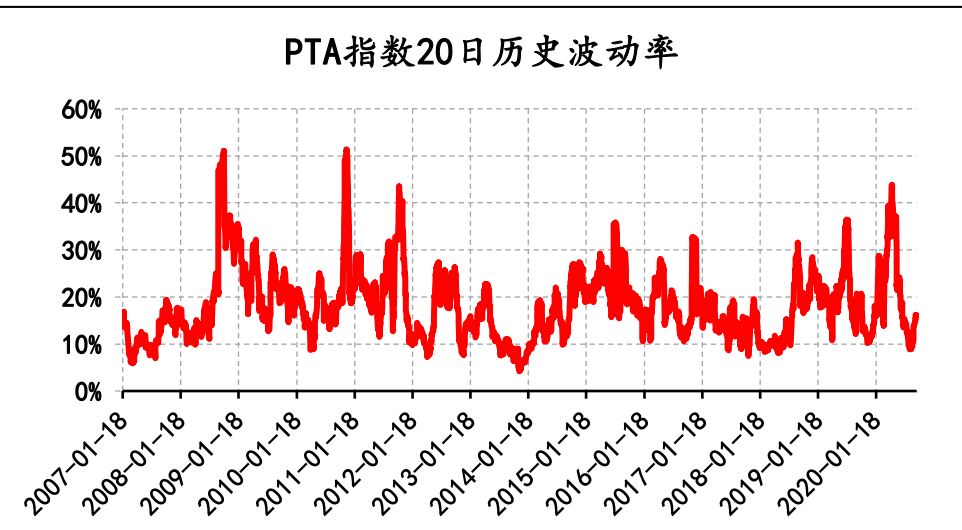
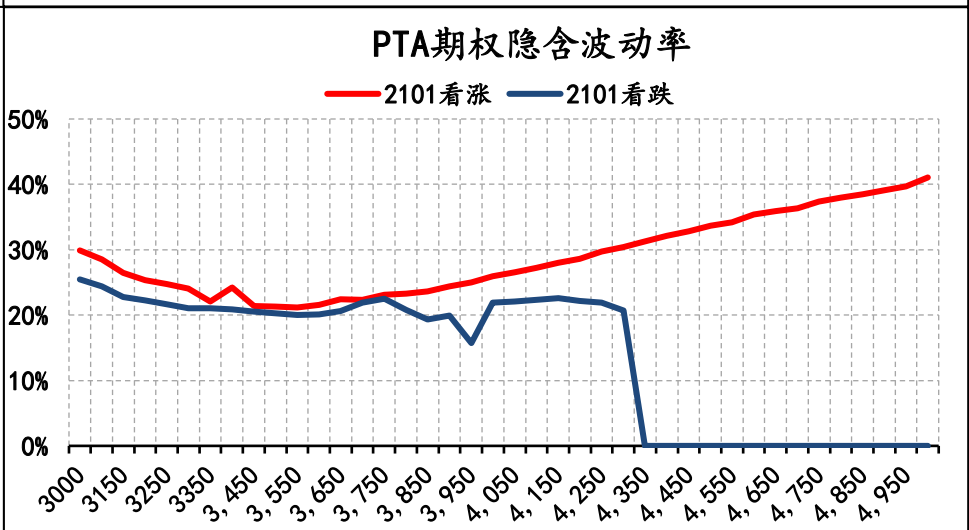
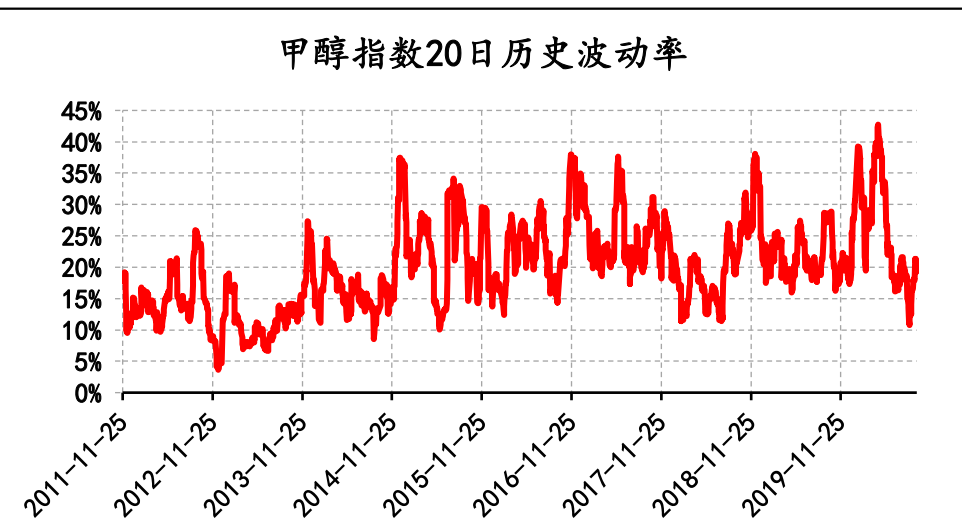
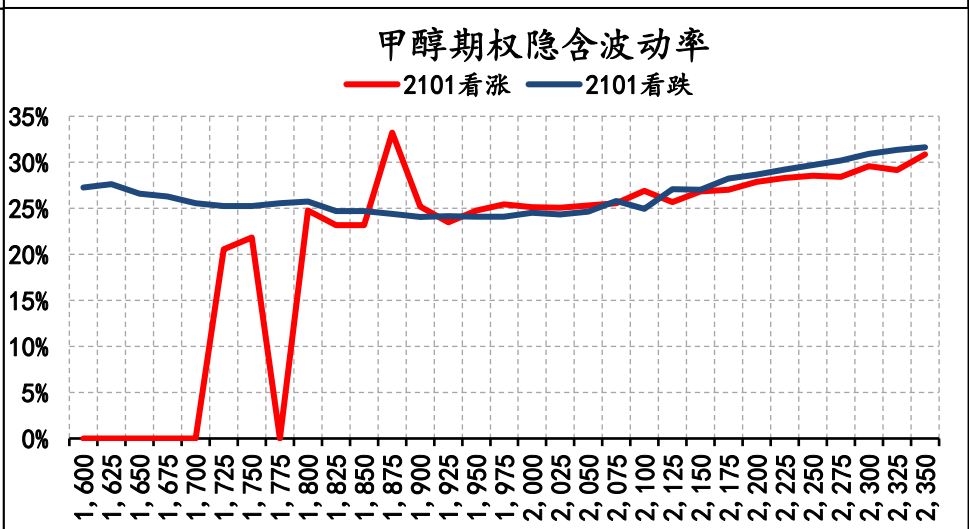
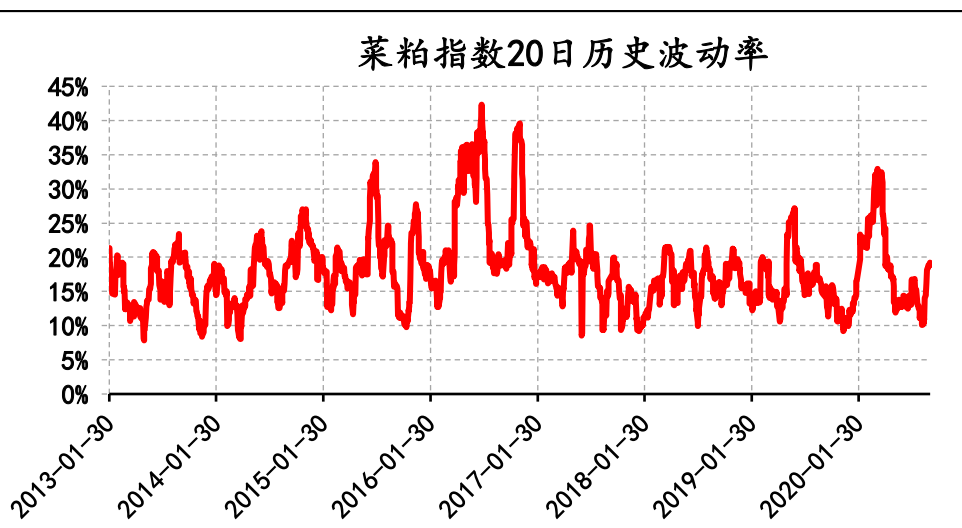
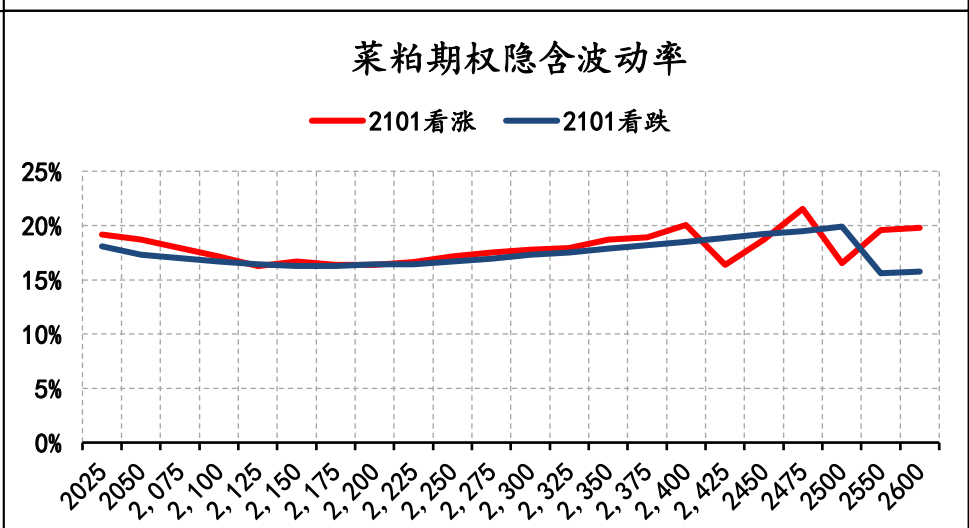
豆粕期权隐含波动率

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 — 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。	