



豆粕期权周报

2017年06月30日 星期一

一、本周简要

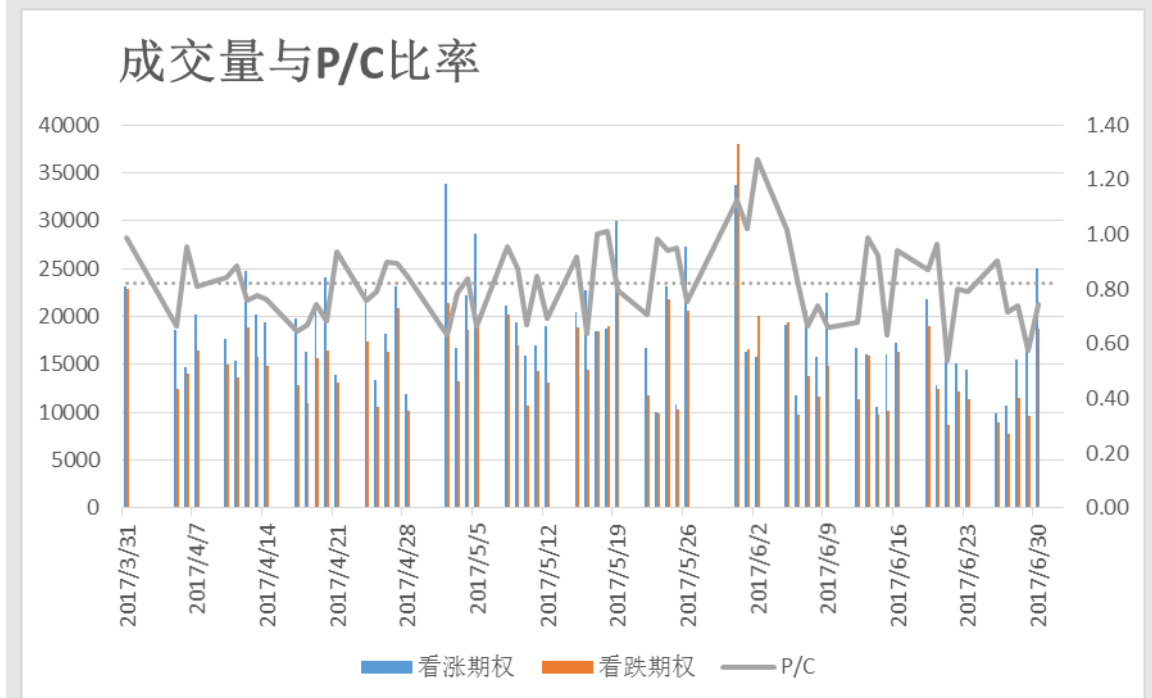
成交量方面，上周总计13万4千手，日均成交2万6千手，比上周略有减小，其中看涨期权日均成交1万5千手，看跌期权日均成交1万1千手。

持仓量方面，总计为216432手，其中看涨期权13万手，看跌期权8万手。

标的方面，主力合约M1709目前维持震荡行情，30天历史波动率接近14%；相应期权隐含波动率目前已经接近20%，反映了投资者对即将公布美国农业部报告以及天气等不确定性因素的情绪。

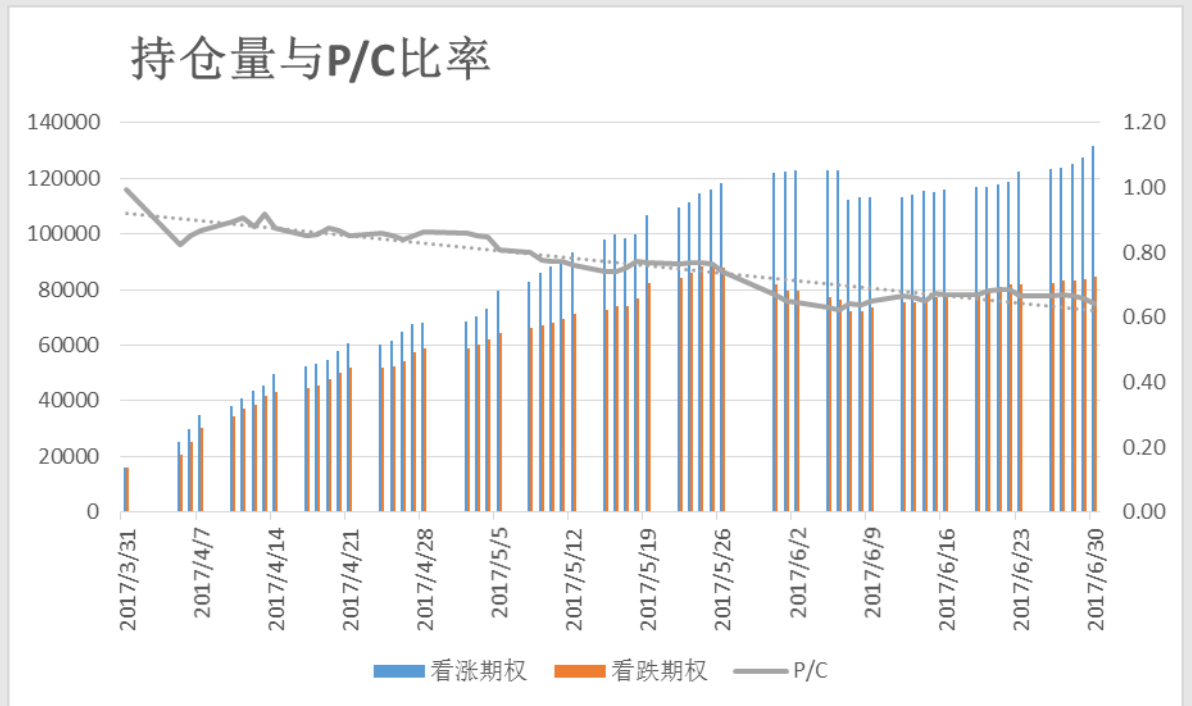
二、图表看市

图1：豆粕期权成交量，P/C(看跌/看涨比率)



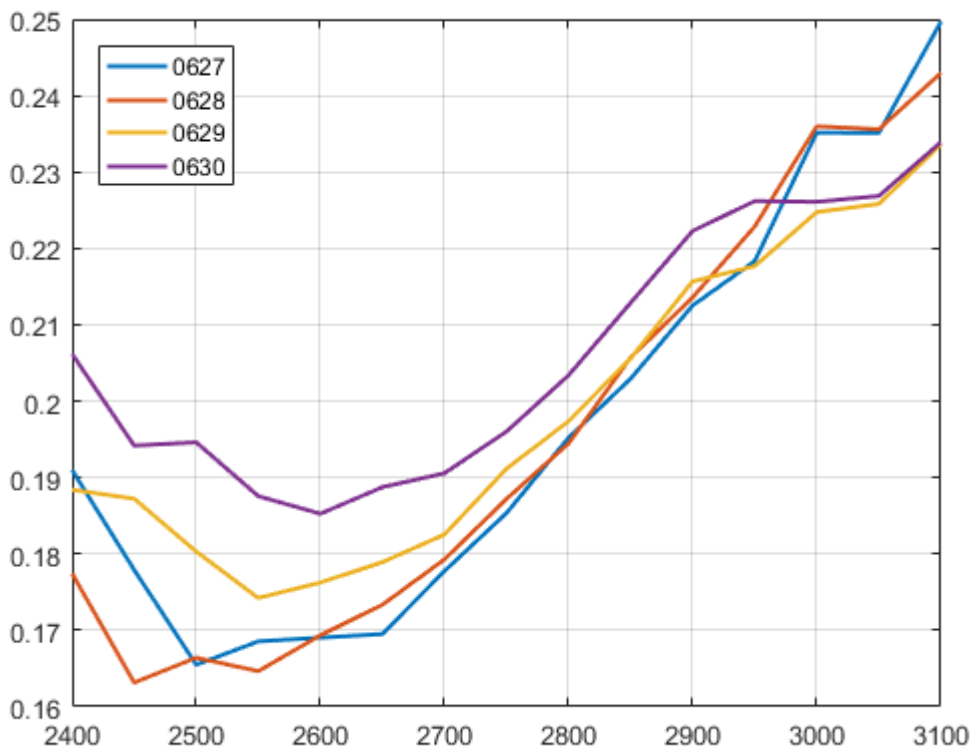
数据来源：大连商品交易所 首創期貨

图 2: 豆粕期权持仓量, P/C(看跌/看涨比率)

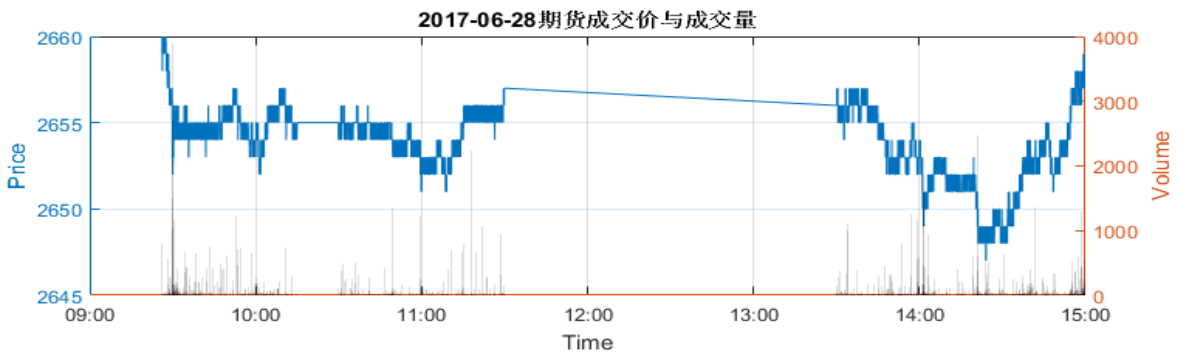
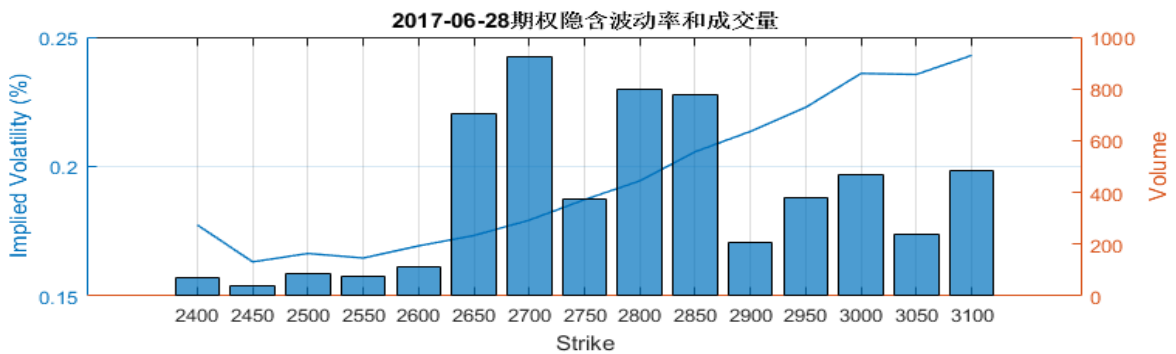
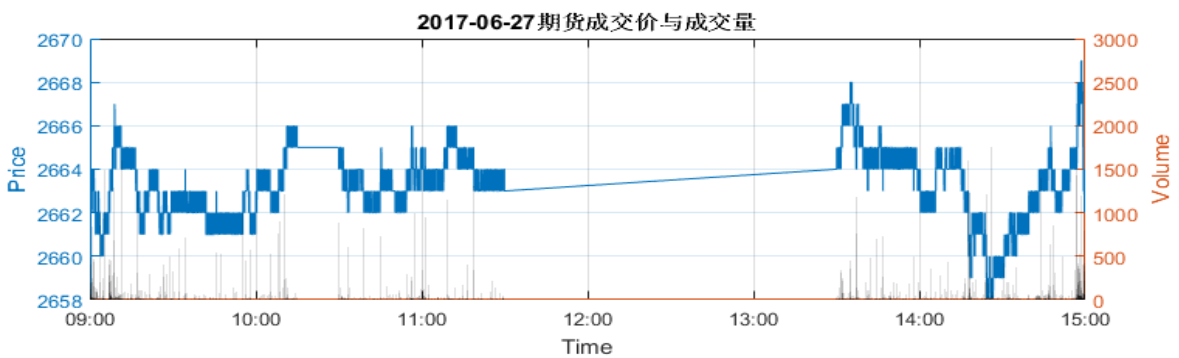
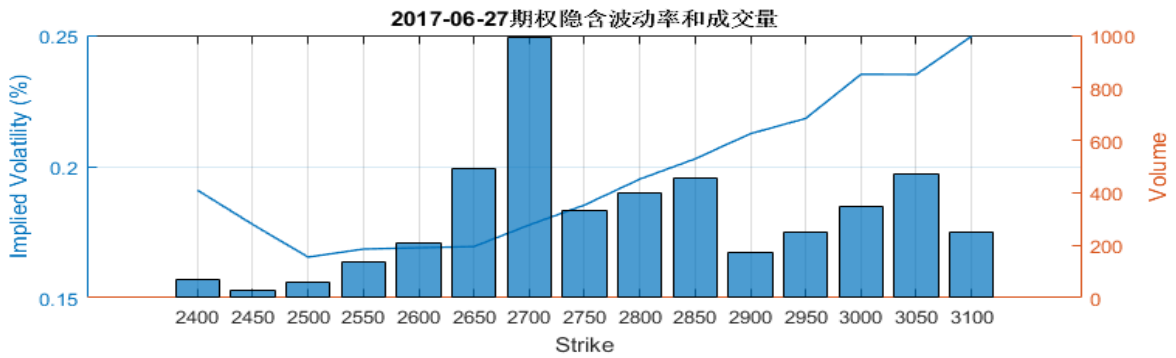


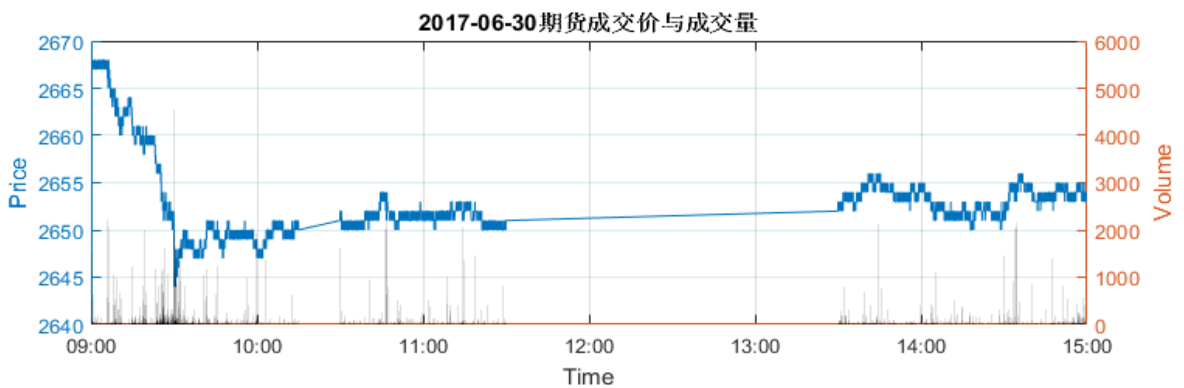
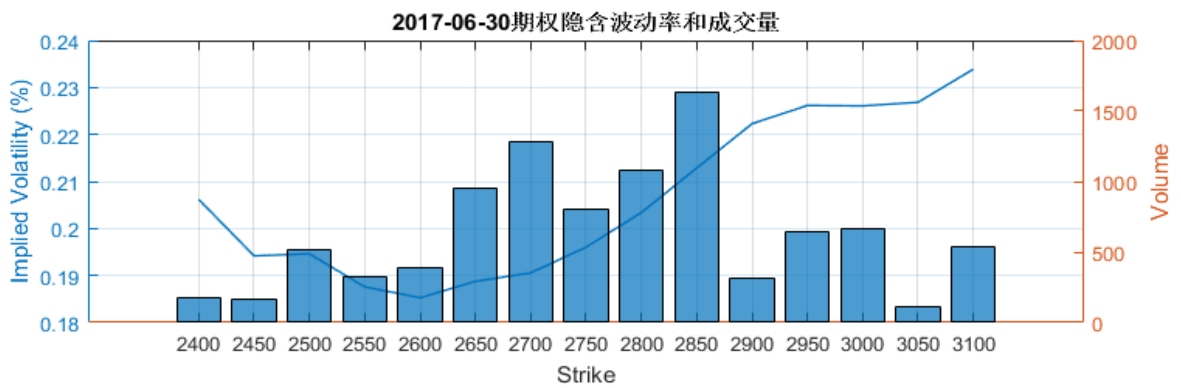
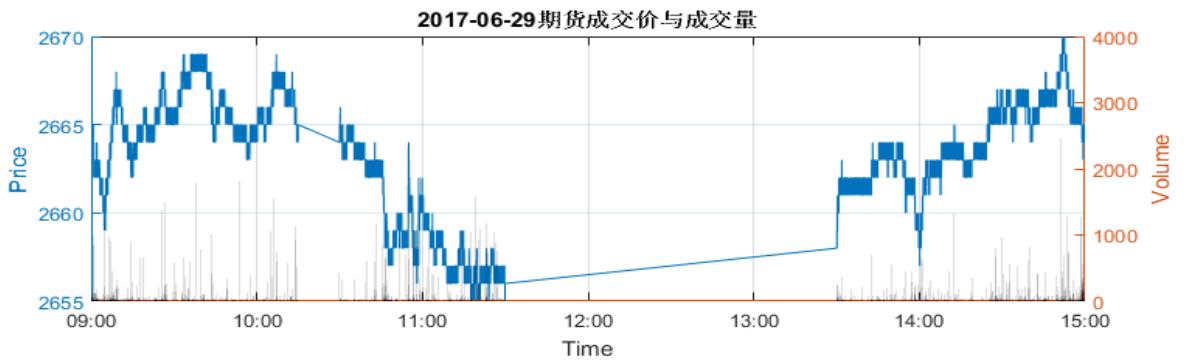
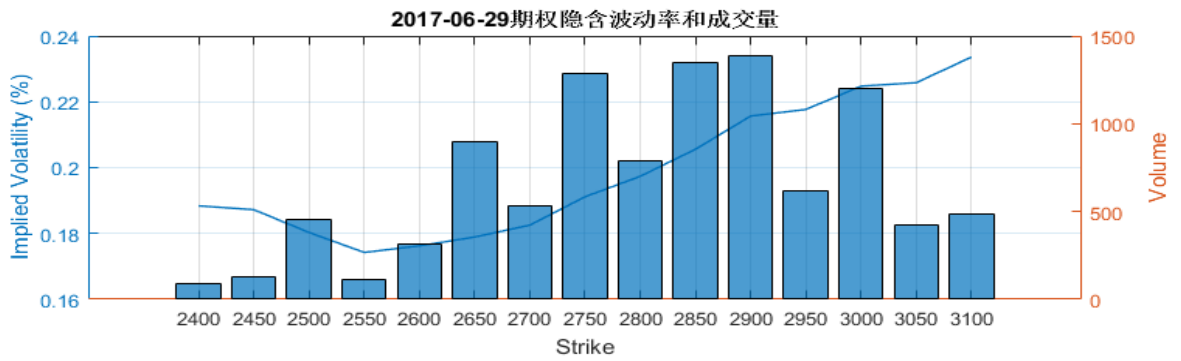
数据来源: 大连商品交易所 首创期货

三、波动率



1709 系列合约隐含波动率与行权价格的关系图如上，由于美国农业部将在 6 月 30 日公布重要报告，平值/实值期权隐含波动率今日上升非常明显，而虚值期权隐含波动率基本维持不变，偏度水平降低。





免责声明

本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不做任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。本报告力求客观、公正，但文中观点、结论和建议仅供参考，并不构成所述品种的操作依据，投资者据此做出的任何投资决策，本公司及报告书写人不承担任何责任。此报告版权属于北京首創期貨有限责任公司，未经首創期貨授权，任何个人、机构不得以任何方式更改、转载、传发及复印。

© 2017年 北京首創期貨有限责任公司 版权所有

营业部及联系方式：

北京首創期貨有限责任公司

公司总部：北京市西城区宣武门
外大街甲1号 环球财讯中心D
座3层
电话：010-58379300

129号大连国际金融中心A座-

大连期貨大厦2505号房间
电话：0411-84800321

路6636号中海环宇城

1006室
电话：0531-86908558

北京北辰东路营业部

地址：北京市朝阳区北辰东路8
号亚运村1号门
电话：010-84973081/82/83

郑州营业部

地址：郑州市未来大道69号未
来大厦1601室
电话：0371-65615346

沈阳营业部

地址：沈阳市和平区南京南
街1甲号欧亚联营商务大
厦1702室
电话：024-23284333

北京长虹桥营业部

北京市朝阳区东三环北路19号
中青大厦1506号
电话：010-65088620

哈尔滨营业部

地址：哈尔滨市南岗区中心大道
160号哈西万达B1栋写字楼
2601室
电话：0451-86601286

厦门营业部

地址：厦门市思明区湖滨南
路90号立信广场2404室
电话：0592-3299310

上海营业部

地址：上海市浦东新区福山路
458号1901, 1911, 1912室
电话：021-58207067

昆明营业部

地址：昆明市护国路2-4号广业
大厦B幢15楼A区
电话：0871-63116976

南宁营业部

地址：广西南宁市青秀区金
湖路28号和实·水榭花都
1号楼7号商铺2072室
电话：0771-5776618

大连营业部

地址：大连市沙河口区会展路

济南营业部

地址：济南市市中区二环南

长沙营业部

地址：长沙市芙蓉区五一大
道800号中隆国际大厦8

楼 801 室

电话:

0731-82681607/1607

赤峰营业部

地址: 内蒙古赤峰市新城区临潢

大街水榭花都 B 区南门东 100

米

包头营业部

地址: 包头市青山区钢铁大

街 10 号中环大厦 B-708、

710、712、714 号

电话: 0472-6167900

杭州营业部

地址: 杭州市滨江区江晖路 1961

号隆和国际大厦 404

重庆营业部

地址: 重庆市渝中区黄花园

双钢路三号(科协大厦)第

19 楼 1912 号写字间

电话: 023-63512730

深圳营业部

地址: 深圳市南山区深南大道与

铜鼓路交汇处华润置地大厦 E 座

33 层 A1

电话: 0755-82802207

成都营业部

四川省成都市锦江区东大街紫东

楼段 35 号明宇金融广场 1904B

室

武汉营业部

地址: 湖北省武汉市武昌区中北

路 86 号汉街总部国际 B 座 3401

室