



豆粕期权周报

2017年06月23日 星期五

一、本周简要

成交量方面，上周总计14万4千手，日均成交2万8千手，其中看涨期权日均成交1万6千手，看跌期权日均成交1万2千手。

持仓量方面，总计为204216手，其中看涨期权12万手，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15%；相应期权隐含波动率从5月19日的14.8%稳定上升到目前19%左右。

二、图表看市

图1：豆粕期权成交量，P/C(看跌/看涨比率)

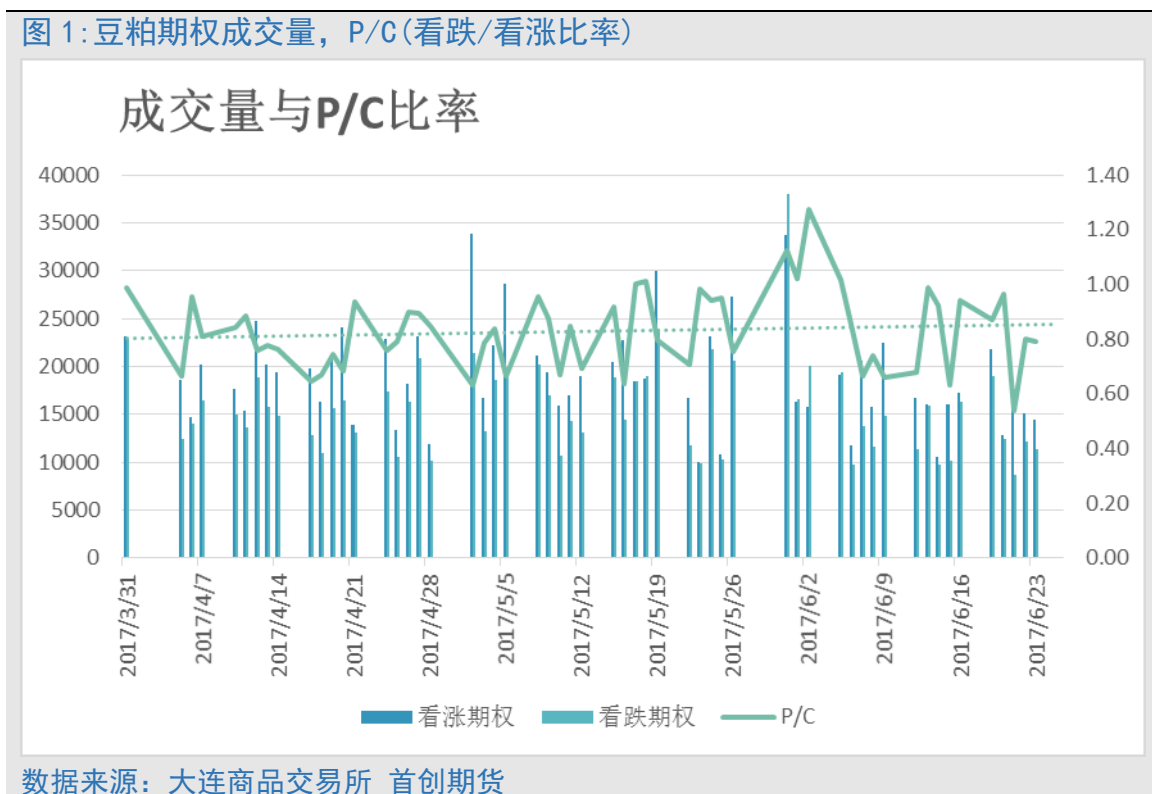
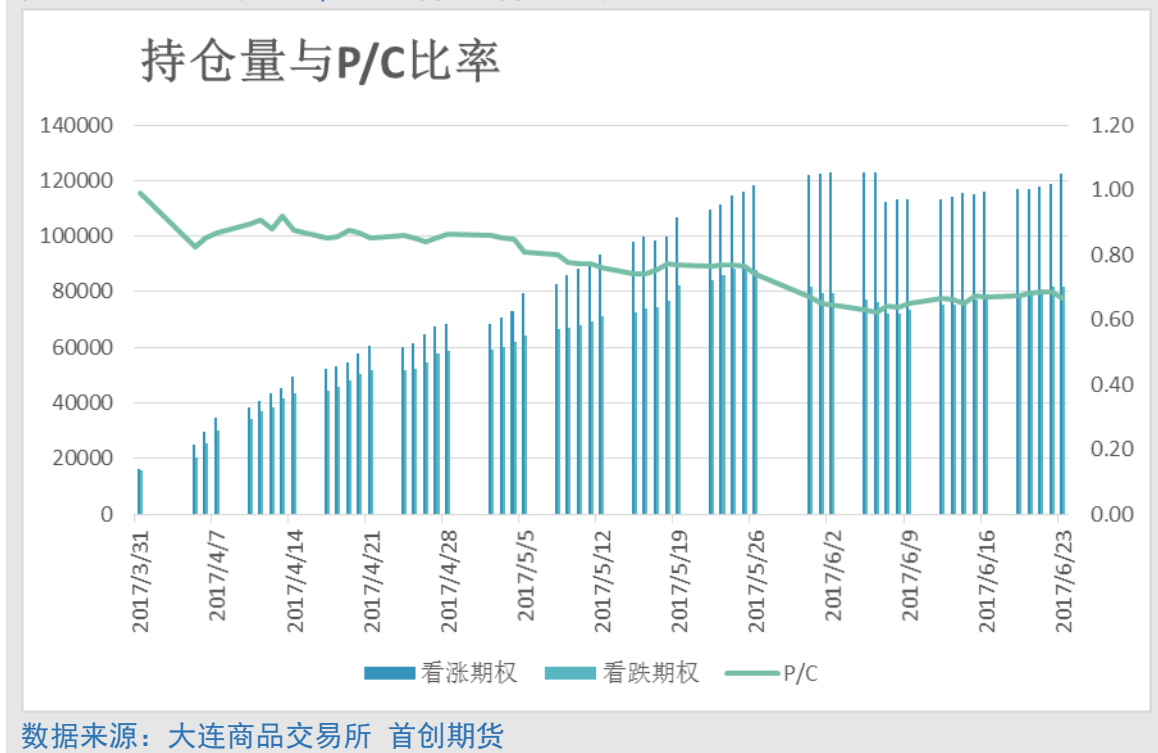
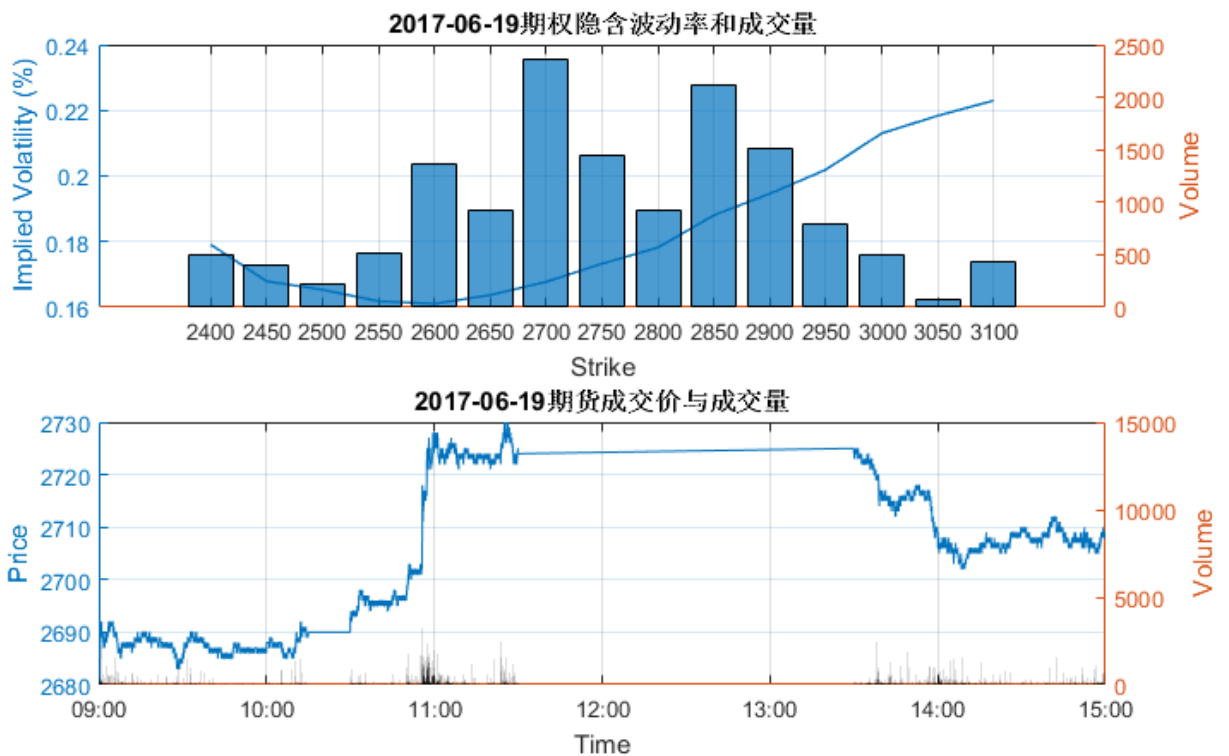


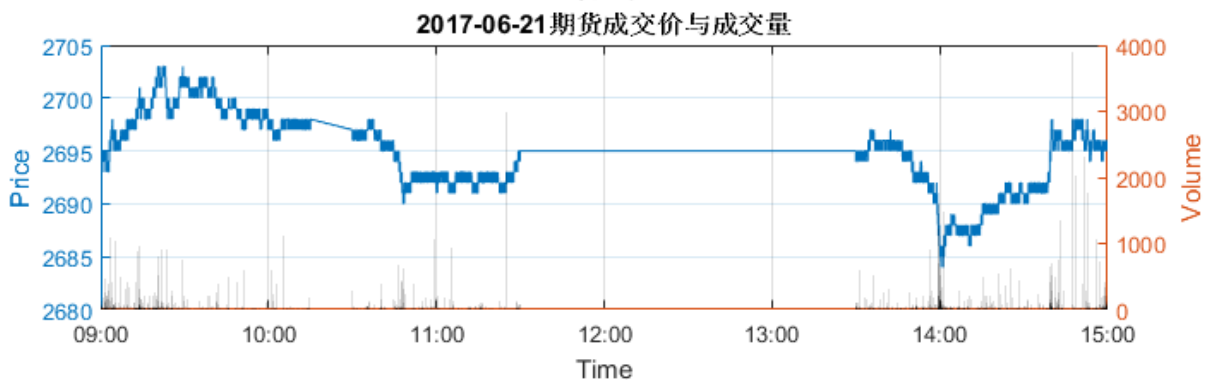
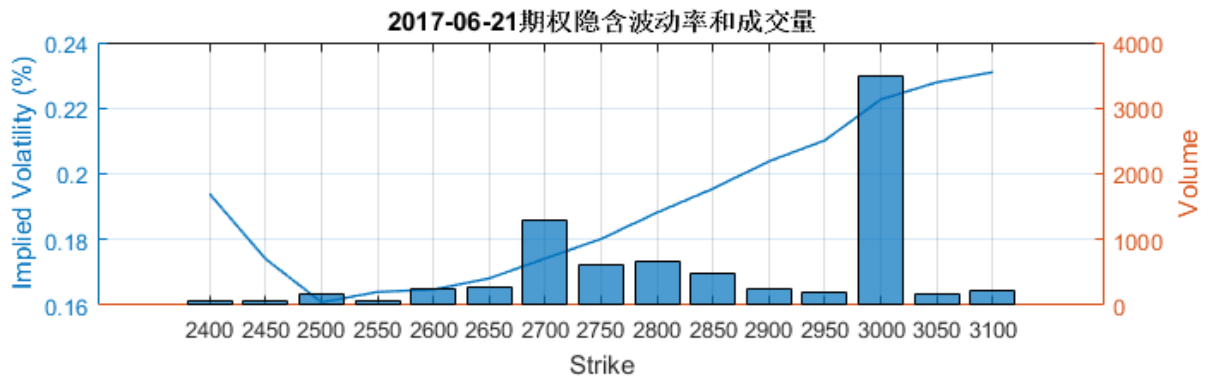
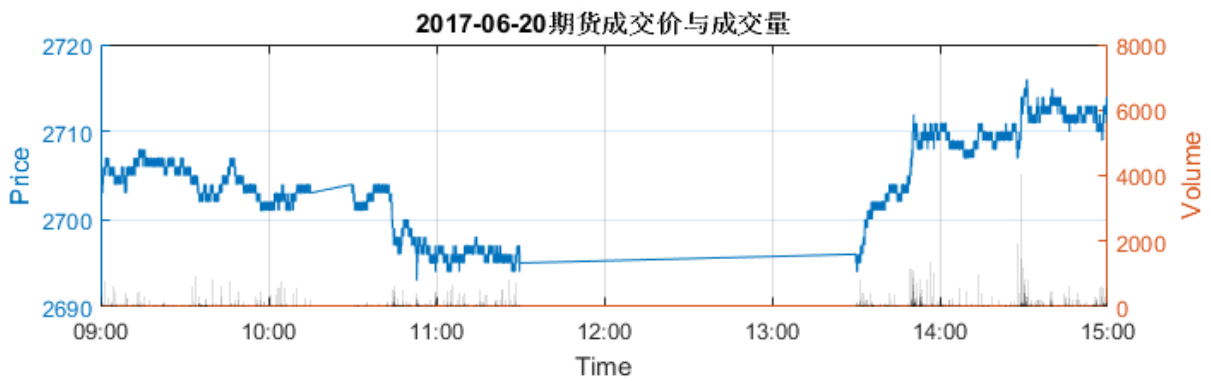
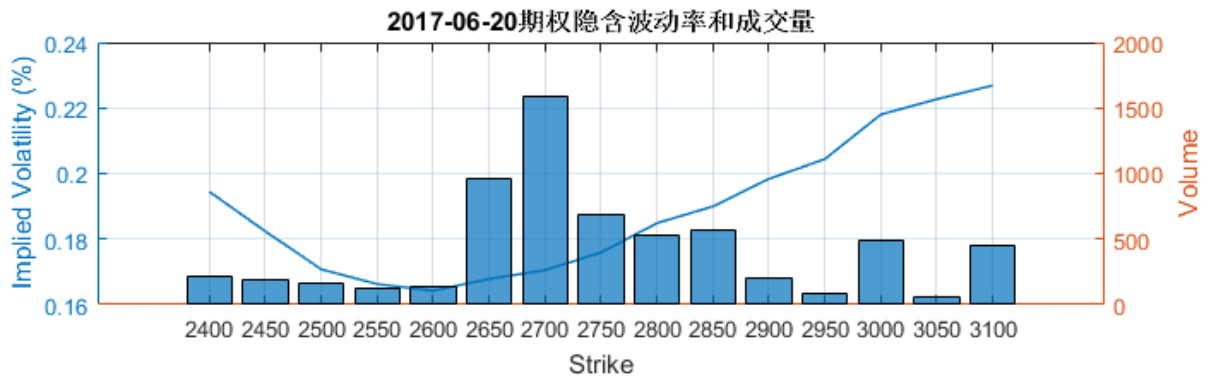
图 2: 豆粕期权持仓量, P/C(看跌/看涨比率)

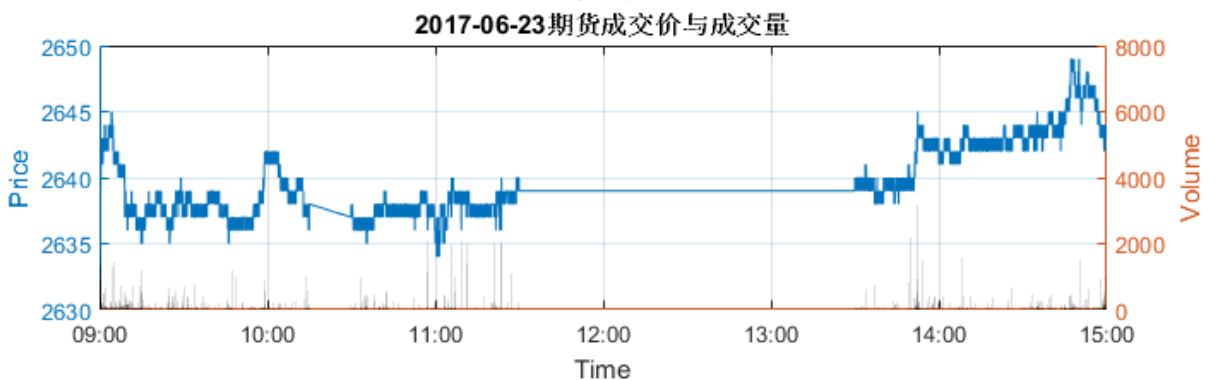
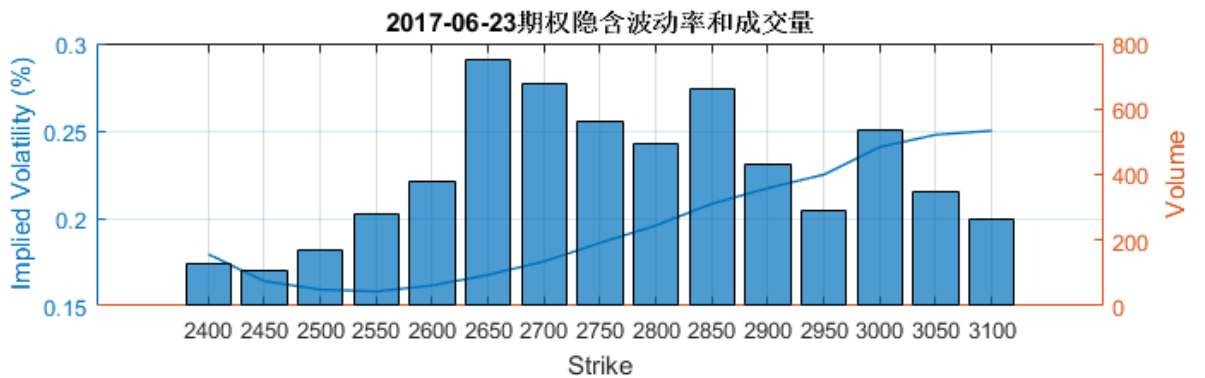
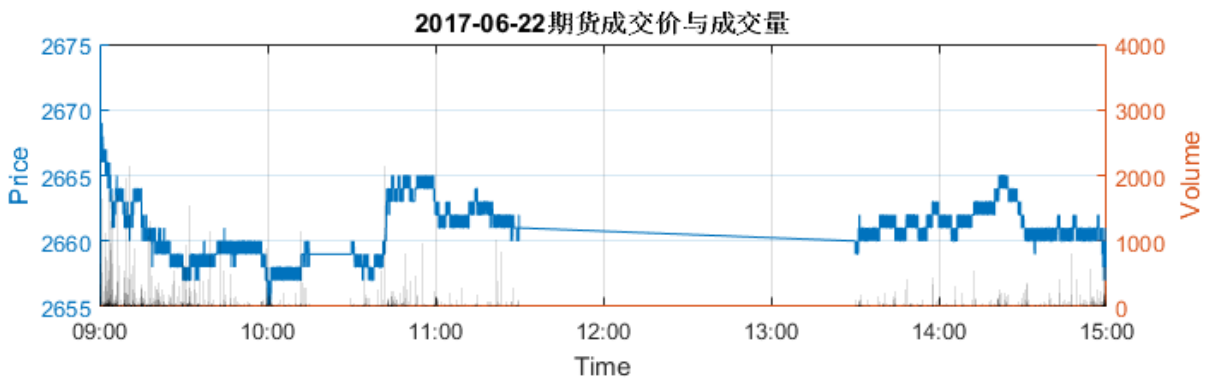
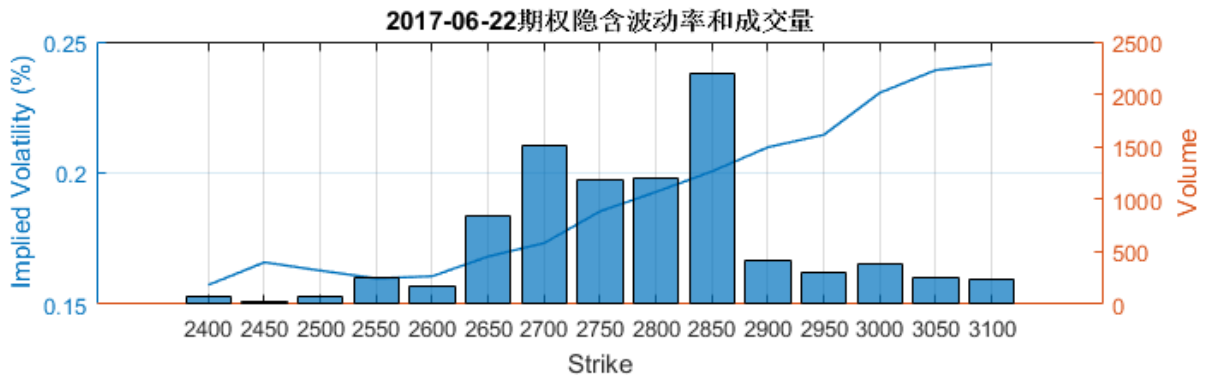


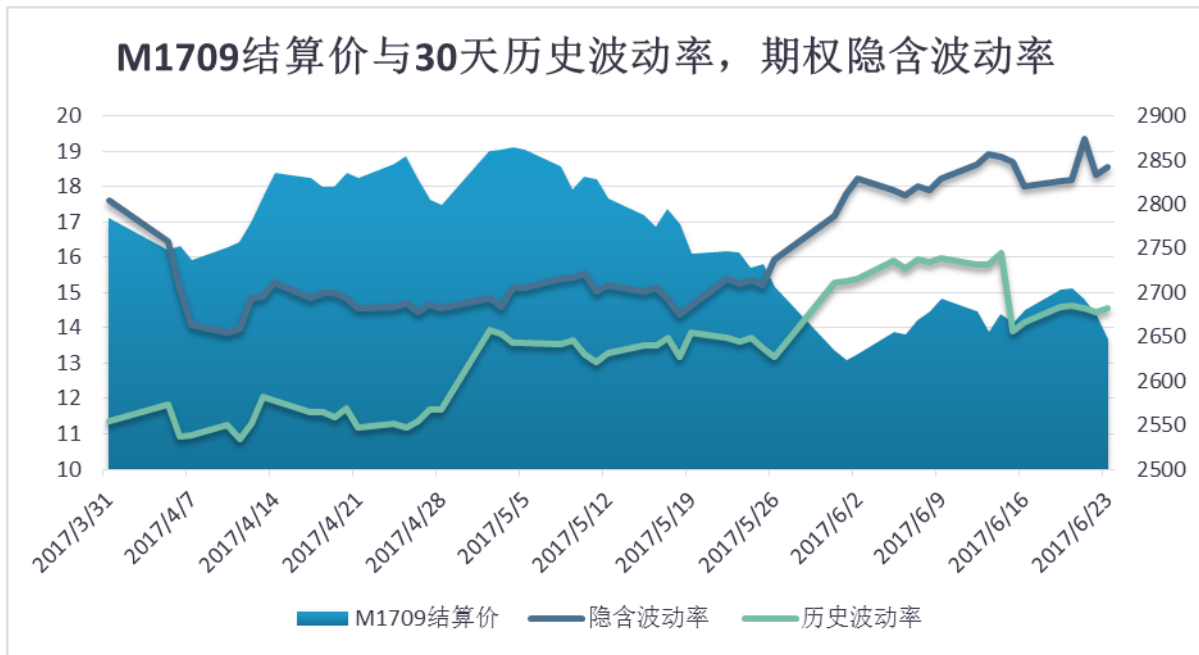
三、波动率

以下是本周主力合约 1709 系列期权的成交量与隐含波动率的情况（不包括夜盘），隐含波动率为成交量加权平均后的值，









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创期货有限责任公司，未经首创期货授权，任何个人、机构不得以任何方式更改、转载、传发及复印。

© 2017 年 北京首创期货有限责任公司 版权所有

分析师：张永正
执业资格编号：F3028856
电话：010-58379529
邮箱：zyz@scqh.com.cn

更多报告
请关注

