

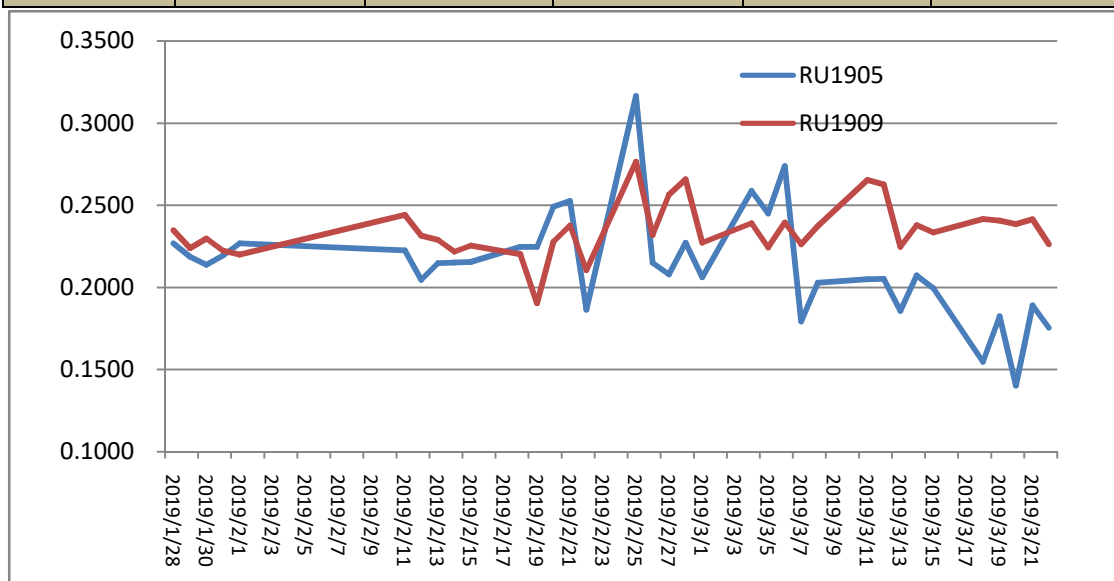
20190322 天然橡胶期权

一、 市场概况

标的	开盘价	收盘价	涨跌	成交量	持仓量	持仓变化	
RU1905	11930	11880	-0.63%	225760	248276	782	
看涨期权							
指标	简称	收盘价	涨跌幅	成交量	持仓量	Delta	Gamma
最大成交量	RU1905C12000	199	-36.00%	498	1698	0.4504	0.0005
最大持仓量	RU1905C13000	45	-6.25%	302	2330	0.0864	0.0002
最大成交量	RU1909C12250	733	-2.27%	52	318	0.0530	0.0002
最大持仓量	RU1909C12500	626	-2.34%	24	634	0.4454	0.0002
看跌期权							
指标	简称	收盘价	涨跌幅	成交量	持仓量	Delta	Gamma
最大成交量	RU1905P11500	90	-38.70%	264	1664	-0.2964	0.0004
最大持仓量	RU1905P11500	90	-38.70%	264	1664	-0.2964	0.0004
最大成交量	RU1909P11000	230	-14.50%	264	450	-0.2138	0.0002
最大持仓量	RU1909P11000	230	-14.50%	264	450	-0.2138	0.0002

二、 波动率概况

历史分位数	30 日波动率	历史分位数	60 日波动率	历史分位数	90 日波动率
10%	19.99	10%	16.73	10%	18.85
25%	20.66	25%	17.54	25%	19.36
50%	21.91	50%	20.10	50%	19.71
75%	22.57	75%	21.08	75%	19.87
100%	23.50	100%	21.40	100%	21.02
当日值	22.41		21.17		18.56



三、 认沽认购概况

成交历史分位数	认沽认购比	持仓历史分位数	认沽认购比
10.00%	0.45	10.00%	0.49
25.00%	0.48	25.00%	0.51
50.00%	0.53	50.00%	0.57
75.00%	0.64	75.00%	0.60
100.00%	0.90	100.00%	0.63
当日值	0.35		0.59

