

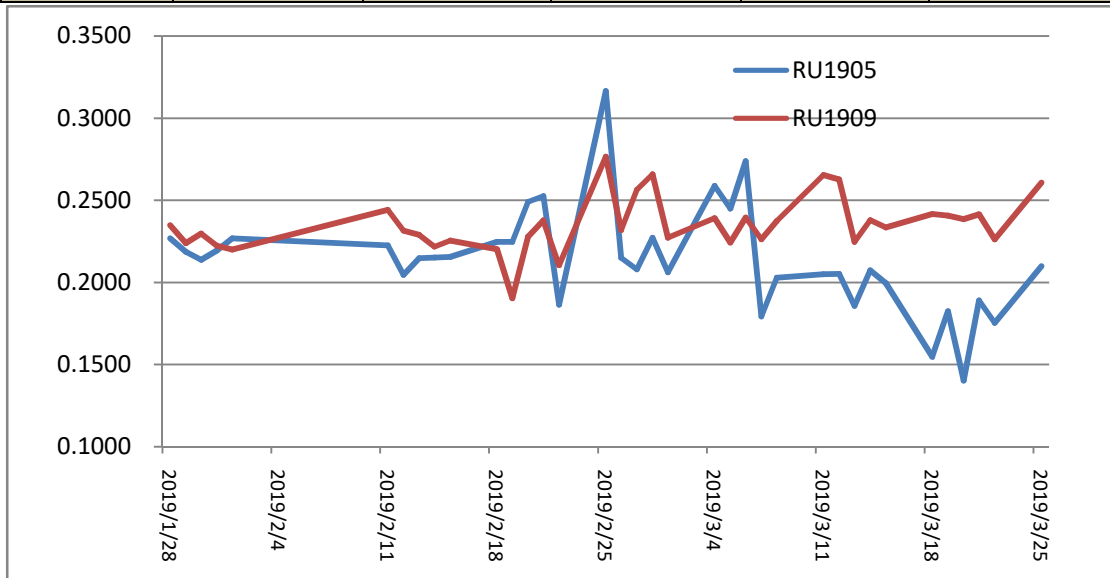
20190325 天然橡胶期权

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	11845	11500	-3.20%	327896	262322	14046	
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	RU1905C13000	23	91.67%	272	2288	0.0287	0.0001
最大持仓量	RU1905C13000	23	91.67%	272	2288	0.0287	0.0001
最大成交量	RU1909C14250	188	60.68%	54	190	0.1062	0.0001
最大持仓量	RU1909C12500	460	-5.39%	8	704	0.3673	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	206	-5.50%	190	1664	-0.4839	0.0005
最大持仓量	RU1905P11500	206	-5.50%	190	1664	-0.4839	0.0005
最大成交量	RU1909P12750	1312	8.16%	8	144	-0.6759	0.0002
最大持仓量	RU1909P11250	364	-10.34%	24	518	-0.3403	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%	20.02	10%	16.73	10%	18.85
25%	20.79	25%	17.54	25%	19.36
50%	22.07	50%	20.10	50%	19.71
75%	22.61	75%	21.08	75%	19.87
100%	24.25	100%	21.40	100%	21.02
当日值	24.25		21.98		19.35



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%	0.54	50.00%	0.57
75.00%	0.65	75.00%	0.60
100.00%	0.90	100.00%	0.66
当日值	0.66		0.66

