

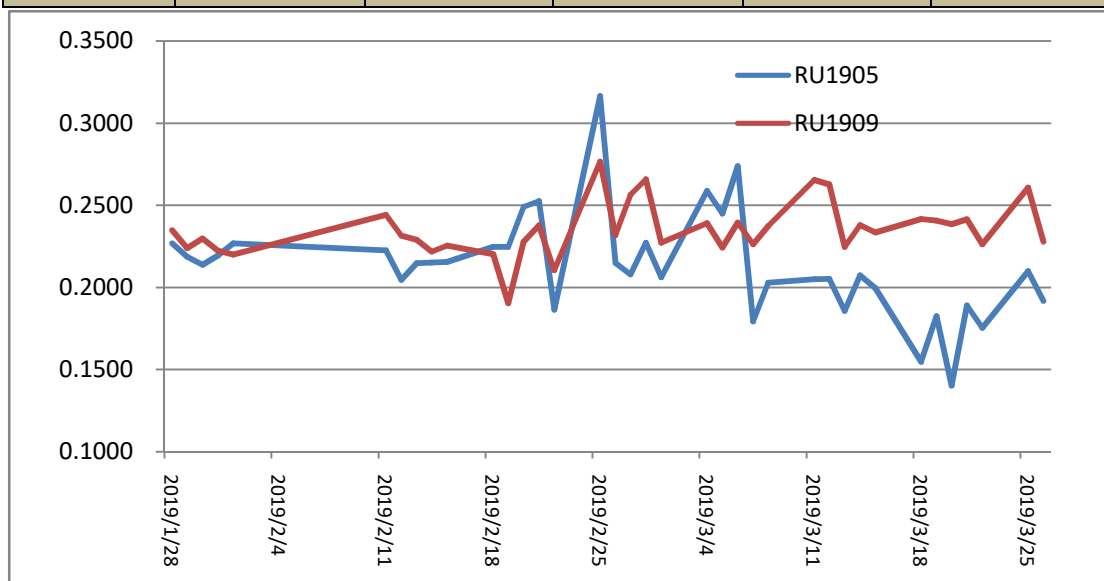
20190326 天然橡胶期权

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	11510	11510	-1.24%	171972	250726	-11596	
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	80	-48.05%	668	1898	0.2653	0.0004
最大持仓量	RU1905C13000	24	100.00%	306	2286	0.0292	0.0001
最大成交量	RU1909C14500	152	63.44%	238	816	0.0847	0.0001
最大持仓量	RU1909C14500	152	63.44%	238	816	0.0847	0.0001
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	190	-12.84%	642	1686	-0.4812	0.0005
最大持仓量	RU1905P11500	190	-12.84%	642	1686	-0.4812	0.0005
最大成交量	RU1909P11000	285	-10.94%	182	580	-0.2862	0.0002
最大持仓量	RU1909P11000	285	-10.94%	182	580	-0.2862	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%	20.06	10%	16.80	10%	18.85
25%	20.92	25%	17.61	25%	19.36
50%	22.24	50%	20.11	50%	19.65
75%	22.71	75%	21.17	75%	19.84
100%	24.25	100%	21.99	100%	21.02
当日值	22.93		21.78		19.33



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%	0.55	50.00%	0.57
75.00%	0.63	75.00%	0.60
100.00%	0.90	100.00%	0.63
当日值	0.63		0.57

