

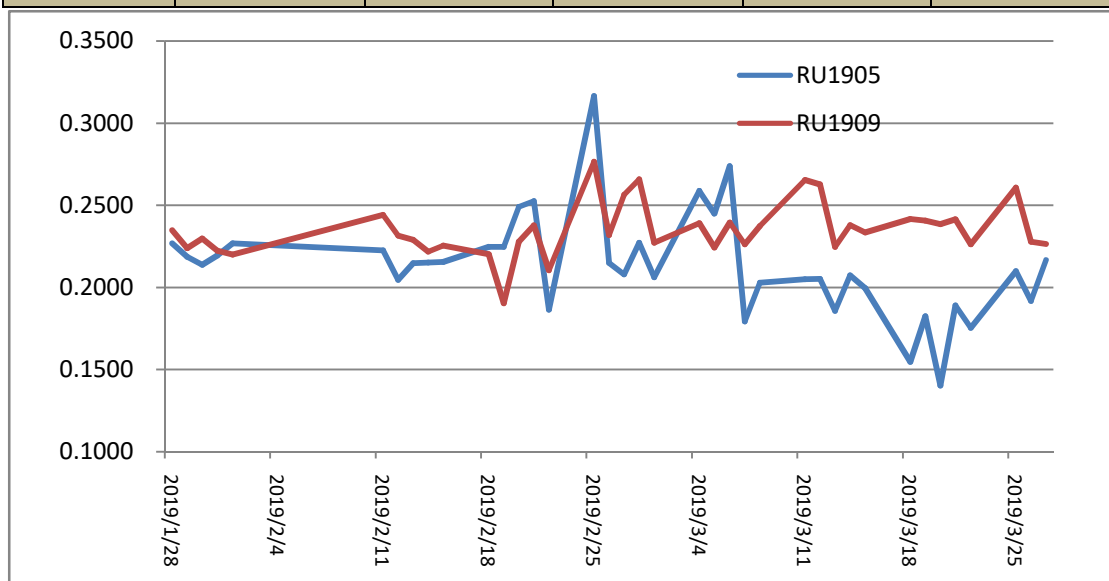
## 20190327 天然橡胶期权

### 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	
RU1909	11820	11640	-1.31%	167658	321790	15860	
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	RU1905C12250	42	-19.23%	156	942	0.0841	0.0002
最大持仓量	RU1905C12000	53	-44.21%	68	1930	0.1507	0.0003
最大成交量	RU1909C12000	528	-10.36%	142	422	0.4245	0.0002
最大持仓量	RU1909C14500	80	12.68%	84	942	0.0641	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	RU1905P11250	184	-4.17%	324	660	-0.4812	0.0005
最大持仓量	RU1905P11500	369	19.03%	216	1222	-0.6309	0.0006
最大成交量	RU1909P10750	291	0.69%	42	482	-0.2862	0.0002
最大持仓量	RU1909P11000	350	-5.66%	22	660	-0.3312	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%	16.84	10%	18.85
25%	20.93	25%	17.66	25%	19.35
50%	22.24	50%	20.11	50%	19.64
75%	22.72	75%	21.20	75%	19.83
100%	24.25	100%	22.01	100%	21.02
当日值	23.34		21.49		19.53



### 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%	0.49	25.00%	0.51
50.00%	0.56	50.00%	0.57
75.00%	0.65	75.00%	0.60
100.00%	0.90	100.00%	0.63
<b>当日值</b>	<b>0.67</b>		<b>0.53</b>

