

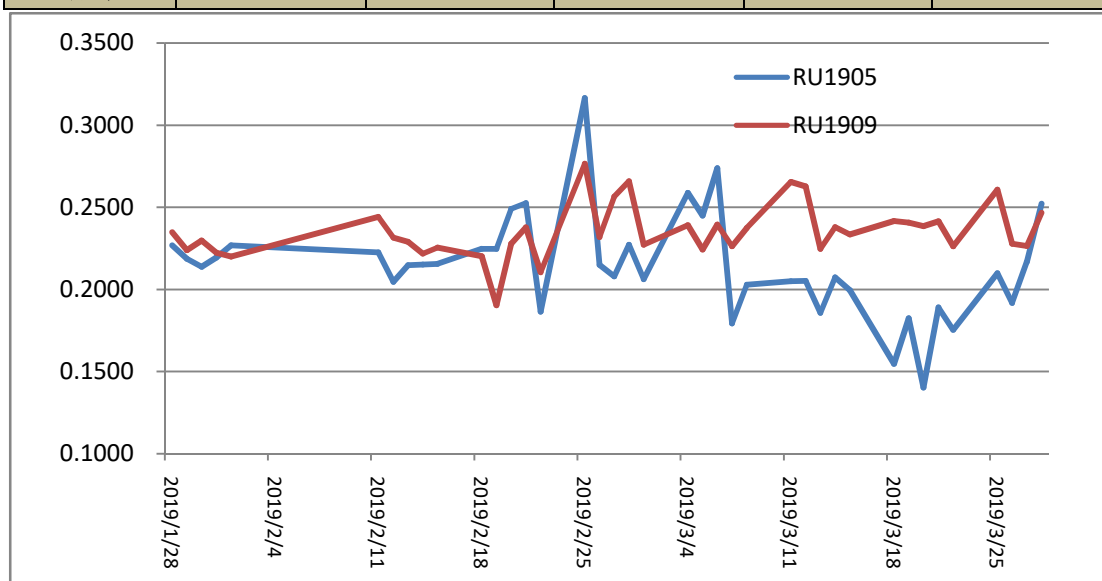
## 20190328 天然橡胶期权

### 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	11640	11470	-2.34%	177542	334898	13108	
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	55	3.77%	244	1920	0.1199	0.0003
最大持仓量	RU1905C12000	55	3.77%	244	1920	0.1199	0.0003
最大成交量	RU1909C14500	107	57.35%	30	948	0.0543	0.0001
最大持仓量	RU1909C14500	107	57.35%	30	948	0.0543	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	RU1905P11000	128	-17.95%	370	1052	-0.3765	0.0006
最大持仓量	RU1905P11500	448	10.07%	112	1092	-0.6704	0.0006
最大成交量	RU1909P11000	411	-9.67%	66	744	-0.3445	0.0002
最大持仓量	RU1909P11000	411	-9.67%	66	744	-0.3445	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%	20.13	10%	16.88	10%	18.85
25%	20.94	25%	17.71	25%	19.35
50%	22.24	50%	20.11	50%	19.64
75%	22.82	75%	21.24	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%	0.48
25.00%	0.49	25.00%	0.51
50.00%	0.56	50.00%	0.57
75.00%	0.66	75.00%	0.60
100.00%	0.90	100.00%	0.63
<b>当日值</b>	<b>0.78</b>		<b>0.48</b>

