

2018年10月11日 星期四



铜陵有色

## 期权日报

电子邮箱 jytzzx@jyqh.com.cn

电话 021-68555105

### 每日行情回顾

#### 白糖方面：

白糖期权单日共计成交 95526 手（双边，下同），成交金额 10420 万元，持仓量总量为 287808 手。白糖期货主力合约 SR901 收于 5134，涨跌幅-1.40%。

认沽/认购比率 52.85，多方与空方力量相近。比之前多方成交量减少。体现市场多空均衡。建议做空波动率，卖出跨式期权。

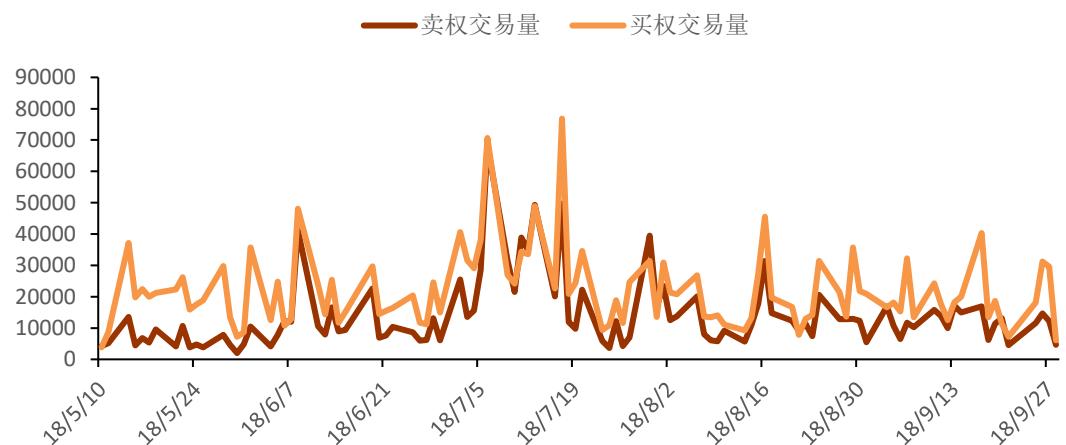
#### 豆粕方面：

豆粕期权单日共计成交 219242 手，成交金额 25161 万元，持仓量总量为 522054 手。豆粕期货主力合约 M1901 收于 3513，涨跌幅 0.92%。

认沽/认购比率 69.99，多方力量大增，并且成交量翻倍，体现了市场多头力量的积聚。建议采取牛市价差策略，买入豆粕看涨期权同时卖出更高执行价格的看涨期权。

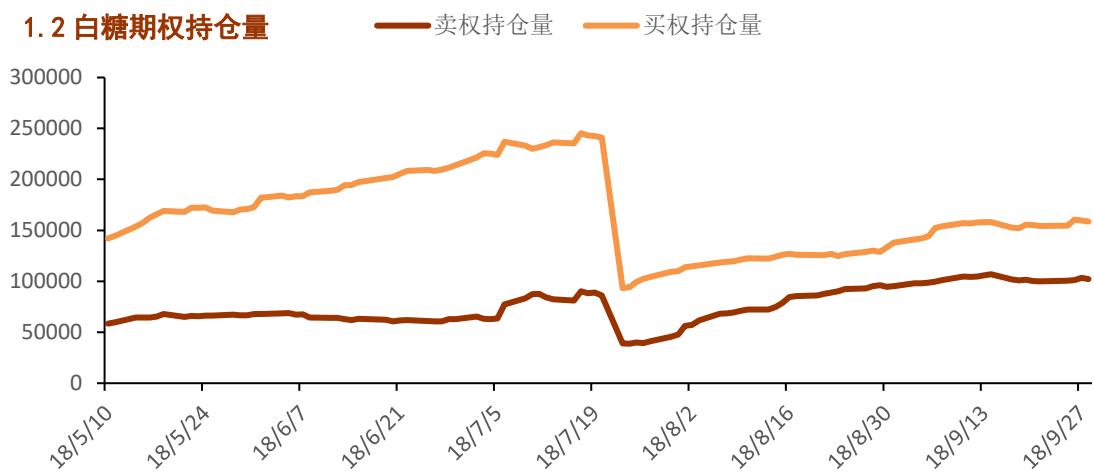
## 一、白糖期权行情概况

### 1.1 白糖期权成交量



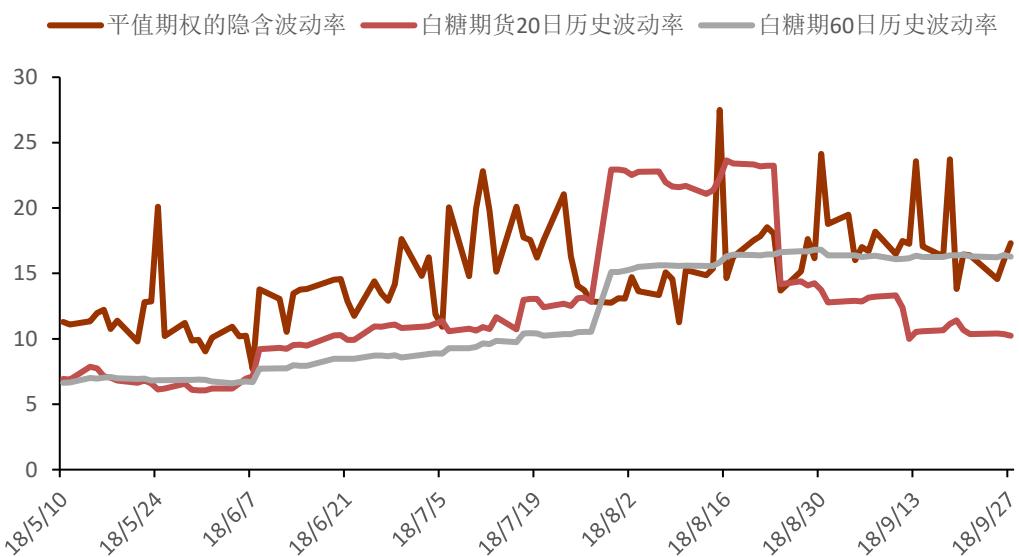
数据来源: wind, 铜冠金源期货

### 1.2 白糖期权持仓量



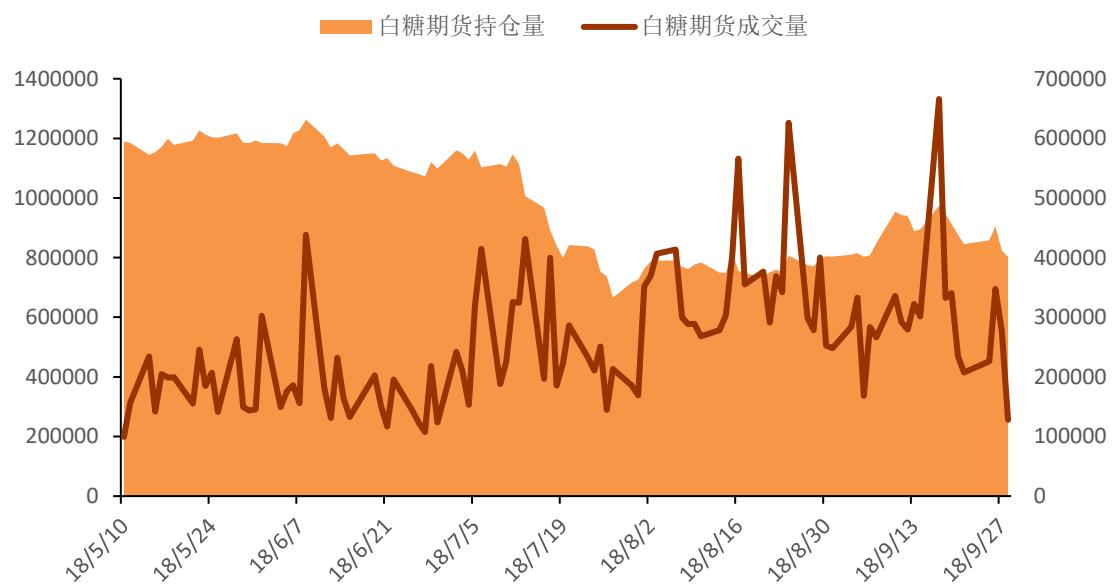
数据来源: wind, 铜冠金源期货

### 1.3 白糖期权隐含波动率



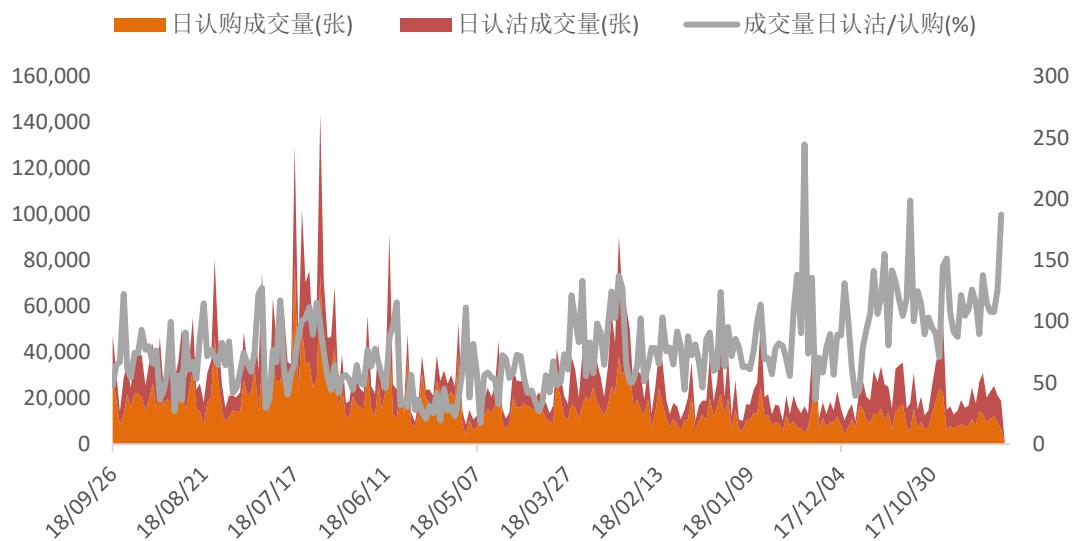
数据来源: wind, 铜冠金源期货

### 1.4 白糖期货成交量和持仓量



数据来源: wind, 铜冠金源期货

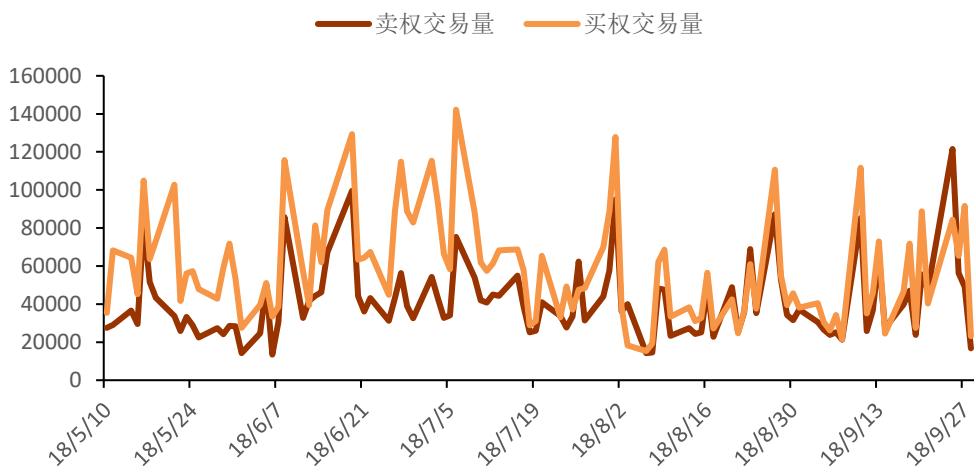
### 1.5 白糖期权认沽/认购比率



数据来源：wind，铜冠金源期货

## 二、豆粕期权行情概况

### 2.1 豆粕期权成交量



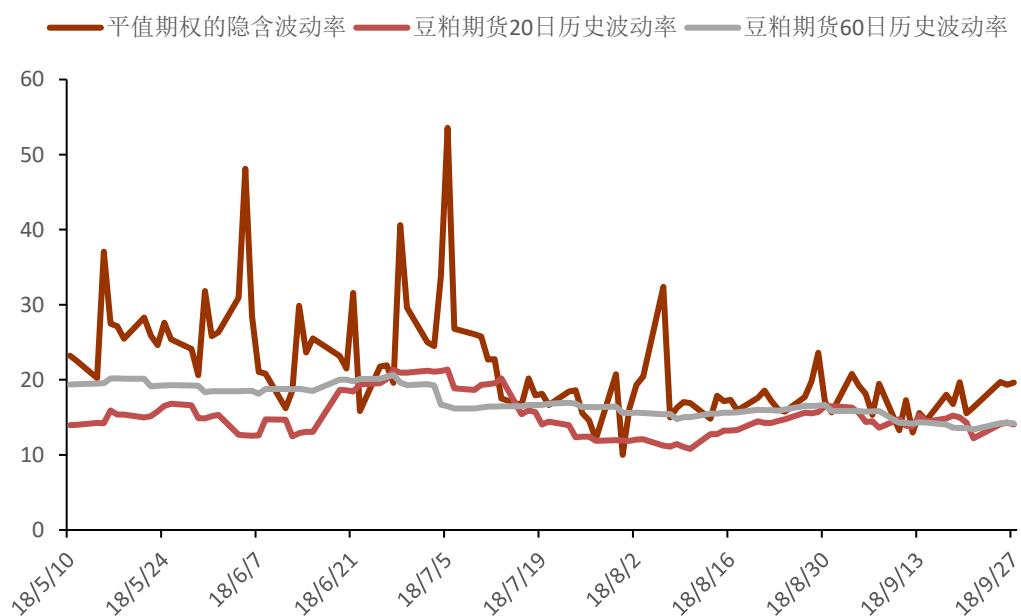
数据来源：wind，铜冠金源期货

## 2.2 豆粕期权持仓量



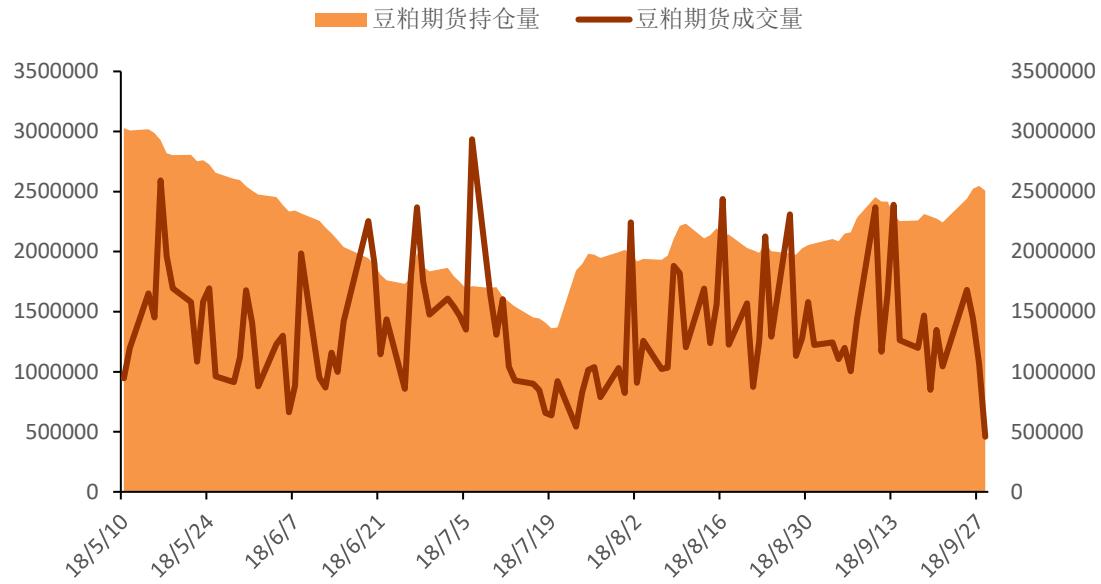
数据来源: wind, 铜冠金源期货

## 2.3 豆粕期权隐含波动率



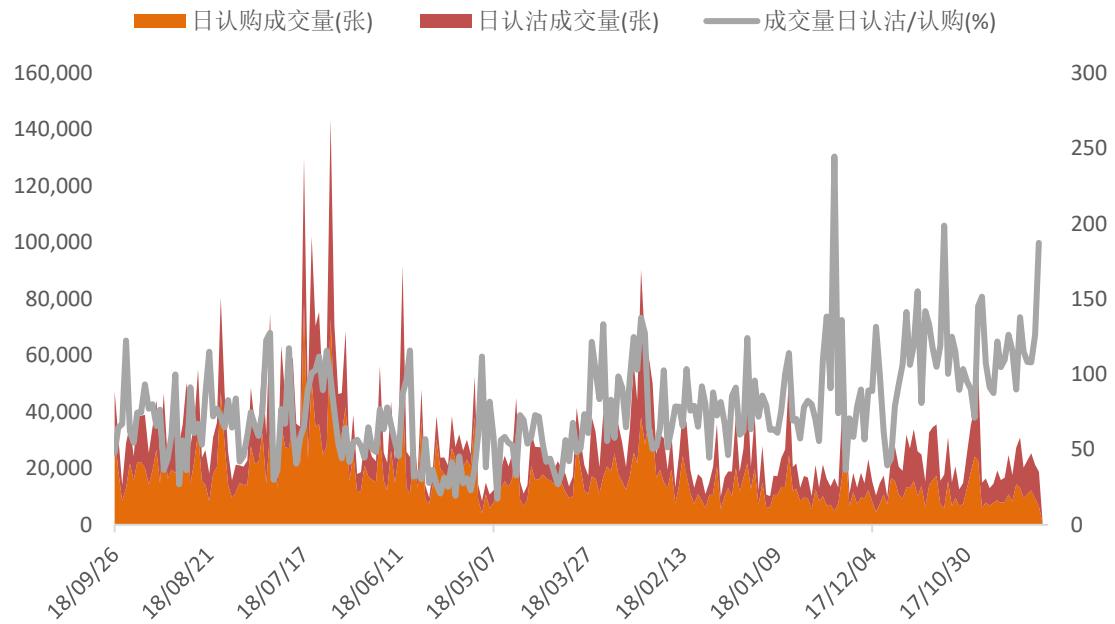
数据来源: wind, 铜冠金源期货

## 2. 4 大豆期货持仓量和成交量



数据来源: wind, 铜冠金源期货

## 2. 5 豆粕期权认沽/认购比率



数据来源: wind, 铜冠金源期货

洞彻风云共创未来

DEDICATED TO THE FUTURE

全国统一客服电话：400-700-0188

### 总部

上海市浦东新区源深路 273 号

电话：021-68559999（总机）

传真：021-68550055



### 上海期货大厦营业部

上海市浦东新区松林路 300 号

2603、2904 室

电话：021-68400688

### 深圳营业部

深圳市福田区彩田路 3069 号星河

世纪大厦 A 栋 2908 室

电话：0755-82874655

### 郑州营业部

河南省郑州市未来大道 69 号未来  
公寓 1201

电话：0371-65613449

### 大连营业部

大连市沙河口区会展路 129 号期货  
大厦 2506B

电话：0411-84803386

### 铜陵营业部

安徽省铜陵市义安大道 1287 号财  
富广场 A2506 室

电话：0562-5819717



### 免责声明

本报告仅向特定客户传送，未经铜冠金源期货投资咨询部授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。本报告中的信息均来源于公开可获得资料，铜冠金源期货投资咨询部力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。

本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标财务状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。