



期权周报

本周视点

,-3 O s \~ jAÑ @ Ô 7 { üEé È < ÄÈ @ ÔH Ní i s È1 Gÿ kGÿ j
7 { Ä -Lu éM' È \$?~ ‡ Gÿ ÿ A Ä -µ éM' È #§ £ k5¢ n/jF 3)ß" ÿ A Ä,-3 OCW k
È 84Ö \~f ¼ È#ØCü u Ä

Bv2Å O s \~ jAÑ @ Ô 7 { È @ ÔH Ní i s È 1 Gÿ kGÿ j 7 { Ä
-Lu éM' È !W- WBvF <" ÿ A Ä -µ éM' È]- WBvF <" ÿ A ÄBv2Å OCW k È 84Ö
\~f ¼ È#ØCü u Ä

期权策略

63<•),-3 O s63<• • D ?4ô 8
†* →|'j ,'-;#Ø ¼-(< Gÿ, '-;Cü O s

Íf)Bv2Å O s63<•(2' 4ô 8
• →|'j ,'-;#Ø O s È < & †* →|'j ,'-;#Ø O s

白糖和豆粕期权行情周度概况

1.1 白糖期权交易简述

白糖期权交易简述
白糖期权交易简述
白糖期权交易简述

1.3 白糖期权隐含波动率

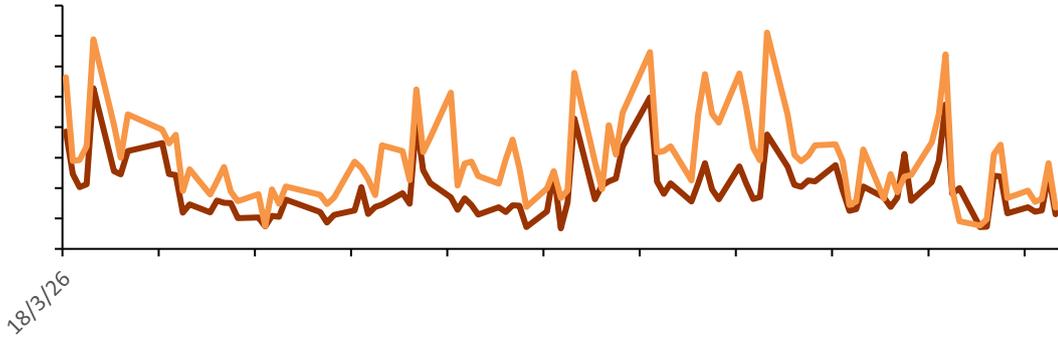


1.4 各类策略收益

z • \$À Ö CtAß K ÆH \$À OCW

2.1 豆粕期权交易简述

豆粕期权交易简述



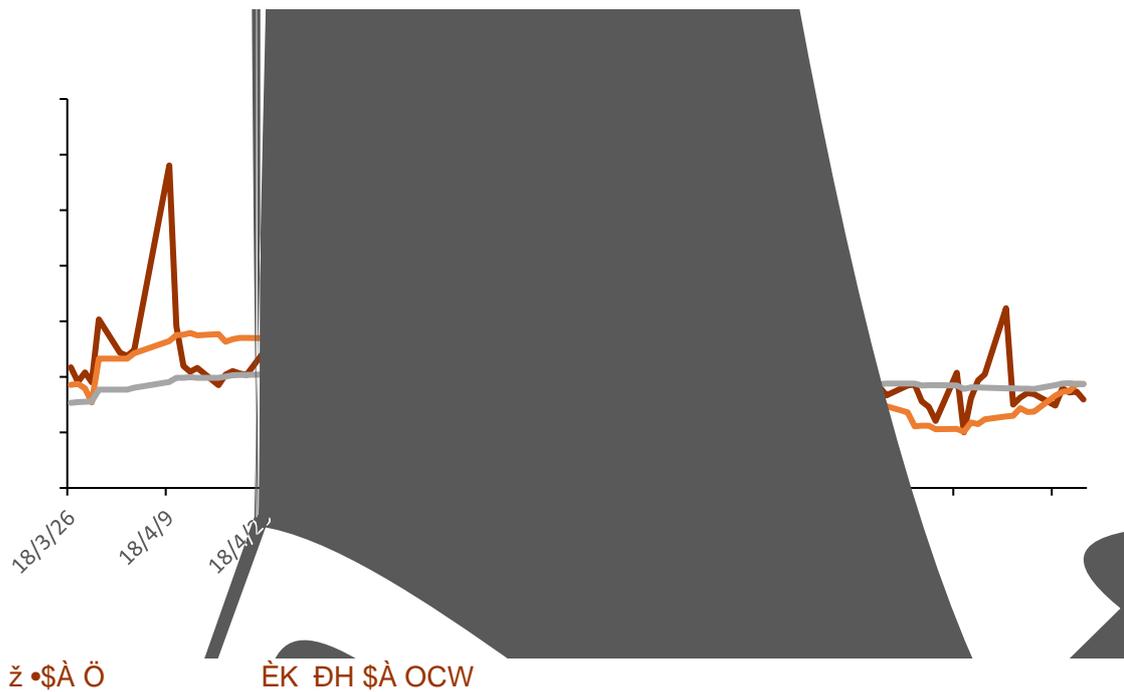
豆粕期权交易简述

2.2 豆粕期权CP_Ratio

84Ö 8	-;#Ø O	-;Cü O	Ä @ ÔGy Ä	-;#Ø O	-;Cü O	1
-	s @ Ô	s @ Ô		s 1	s 1	Gy
	Gy	Gy		Gy	Gy	

豆粕期权交易简述

2.3 豆粕期权隐含波动率



2.4 各类策略收益

ž•\$À Ö CtAß K ĐH \$À OCW

一、 标的资产行情回顾和展望

ž •\$À Ö

ÈK ĐH \$À OCW

ñ/ý	Gý?± àL+	> ð ... K
, -3	ã \$?³ ² "FJE÷#bLu Ô C p CW 84Ö) ,´ * 3 F > ‡ O I È6< ë ¨ < ON´ `,")· j	O Ä
	ã ¨ Ö \$?´ £K^,´] ‡G x jN´AÑ x *+H;G ï X È!] 6+X • Ø3 Ä3 xGÿN´AÑ j	

	<p> \tilde{A} 6 \$? ^ \quad \square \ddot{O}!y X+H;G \times G\ddot{y} $;\text{B3} \quad s \{ \ddot{E} \\$ J, '+H;G 6 J+X \frac{3}{4}$ $+O \times \%_oG.$ </p>	
<p>Bv2\tilde{A}</p>	<p> \tilde{A} 5$\frac{3}{4}$ - "é2- Đ v • J > ~/j È -;#Ø 5$\frac{3}{4}$ - 8 WBv Đ v » Ø WBv Gÿ j - $\frac{3}{4}N' O, ' \quad \ddot{I}:\hat{a} ?6c Èj 9 " \bullet$ 8 Ö1\ $\frac{1}{4}Q$ ÈQ $\frac{3}{4}$ 8, ' \quad \ddot{I}:\hat{a} ? 6c \tilde{A} $\tilde{A} \quad \square \ddot{O} \\$ * \beta - WBvF G\ddot{y}N'$ AÑEî` K4Ú ..., ' 7 X È \quad \square \ddot{O} WBvF Gÿ 7- Î8# 7 X \tilde{A} $\tilde{A}!W- \quad ^ J \text{œ} 3, ' \quad \check{z} n/j È Z8\#$ 8 È!W- \quad \square \ddot{O} WBvF Gÿ j 7 X ÈE³: 0 \square \ddot{O} < OF , ' 7 X < " ;L} \quad \tilde{A}!W- \quad \square \ddot{O}8 8 0 û \tilde{A} </p>	

#N «Np Á ; K Z •

~ -5 0 Ò =+eB Ö

:#§ 2#- L à j\$À\$!D
+eB Ö - Ä k j Ä
P-O Ö -

:#§ 2#- L à j © ÇD
Ä Ö
+eB Ö -



\$! c 2/¿+` j™+`D 'O"ã
F4Ú W Ö ; Ö
+eB Ö -

"ã ‡-1G 2 Z • WFf 'Z •
œ
+eB Ö -

Eí ±-1 WF 2"É"ã j J ...D
' WF OCW W Ö
+eB Ö -

' í-1K L¥ 2 y¹ WFf 'CR
ü - j Ö
+eB Ö -



}CS >

\ Ö z õ A(© Ê Ò g PF1 È Z4ÿ K ĐH \$À OCW Ct ØB G , sAè È+ ... E+X ÆEœE- ú A
1\9 é P Ý, >|j w 7- õ# »CS + Ä \ Ö z], ' ÿ w •\$À ¼ œ 0 9ç ÇCt É ÈH \$À O
CWÄ Ct ØB G È"r ö.ž M• Èv)F È ÿ, ' ö.ž W ú ¼ w = Š + ... Añ È ž!" Ä Ct ÈCS
+8 CO Ä

\ Ö z = ' @ Z ê Ä Ct *Aþ È •"Ñ 963<•` Z [Ò g(©!°, ' Ä Ct- 7CR Ñ(æ å FM0?± Ä Ò g
Ä63<•\ Ö z], ' + ... ??ñ F *Aþ _ V1V 8 !(© Ê(æ å Ä