



【策略建议】

品种	策略建议	策略逻辑
股指	买入 IO2310-P-3600 卖出 IO2310-P-3750	当前时点收益远大于风险。外资抛盘踩踏已基本结束。预计标的波动率下行，布局牛市看跌价差。
甲醇	卖出 MA2311-C-2600 卖出 MA2311-P-2450	原油和煤炭价格保持坚挺。本周企业库存及待发订单增加，甲醇生产企业暂无去库压力。港口库存及社会库存呈现累库趋势，小长假节前终端仍存备货意愿，浙江兴兴 MTO 装置已经重启，市场氛围回暖，甲醇价格偏强震荡，预计波动率下行，布局双卖策略。
棉花	卖出 CF2401-P-16800 卖出 CF2401-C-17800	下游市场成交一般，实际订单的减少也降纺织企业的采购积极性，新棉阶段，疆棉进入喷洒落叶剂的阶段，当下新棉抢收的预期与下游环境的不景气成为市场矛盾点，郑棉处于宽幅震荡的行情当中，布局双卖策略。
白糖	买入 SR2401-C-6800 卖出 SR2401-C-7000	ICE 原糖继续上涨，期价创出 12 年新高，整体处于强势行情之中。郑糖小幅上涨，期价于调整之中支撑有所增强，布局牛市看涨价差。

【金融】

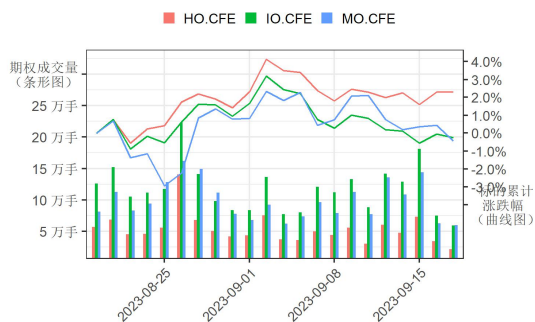
一. 行情简述

上证指数收跌 0.03% 报 3124.96 点, 深证成指跌 0.73% 报 10125.73 点, 创业板指跌 0.88% 报 2002.66 点。市场成交额 6359.3 亿元, 北向资金实际净卖出 24.23 亿元。上证 50 涨 0.12% 报 2532 点, 沪深 300 涨 0.15% 报 3720 点, 中证 1000 涨 0.11% 报 6031 点。

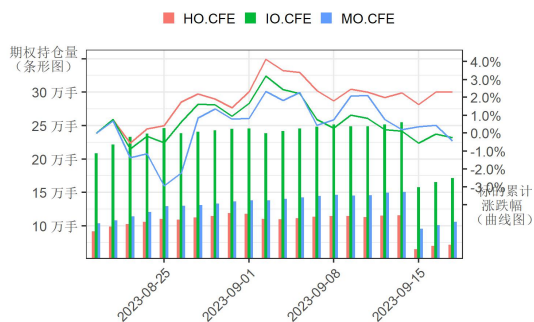


月行情

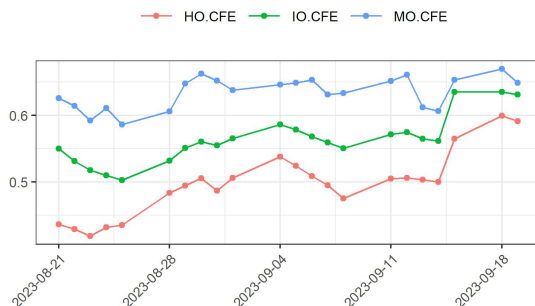
二. 期权成交持仓情况



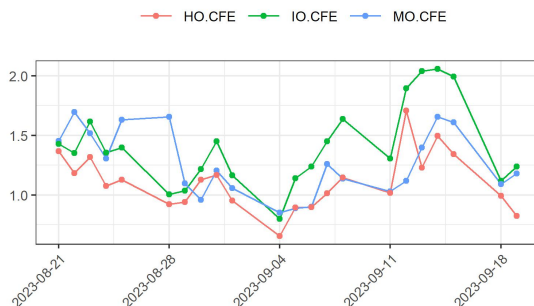
期权成交量——股指



期权持仓量——股指

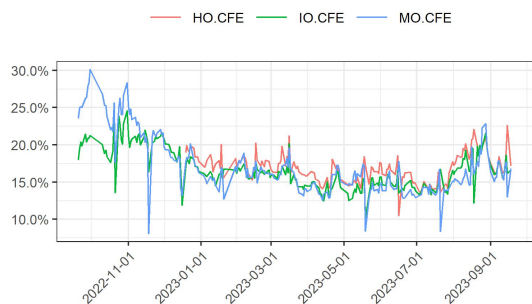


持仓量 PCR——股指

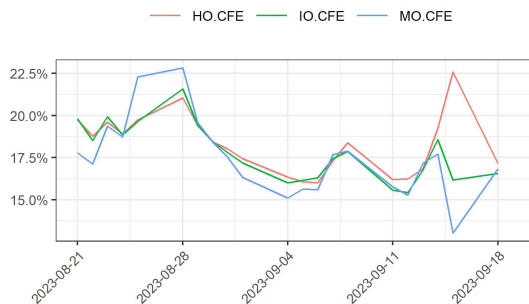


比值 PCR——股指

三. 波动率



近 1 年隐含波动率——股指



近 1 月隐含波动率——股指

【农产品】

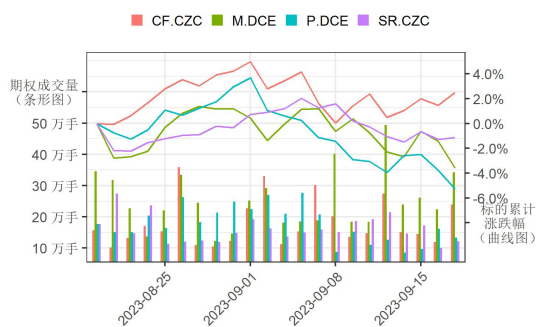
一. 行情简述

农产品多数下跌。豆粕涨 0.13%，棕榈油跌 0.36%，棉花跌 0.17%，白糖涨 0.17%。

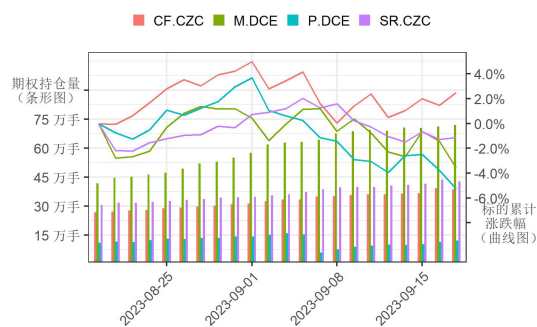


月行情

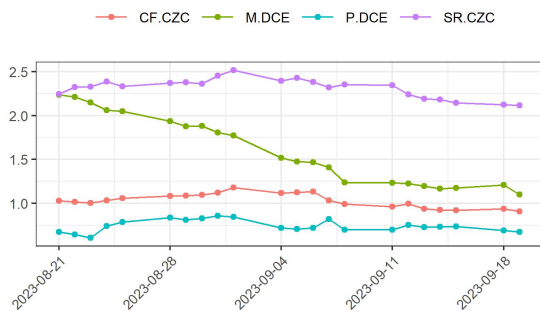
二. 期权成交持仓情况



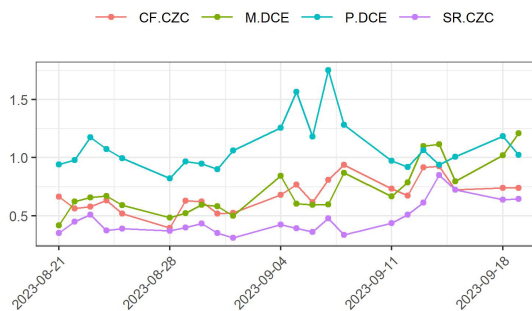
期权成交量



期权持仓量

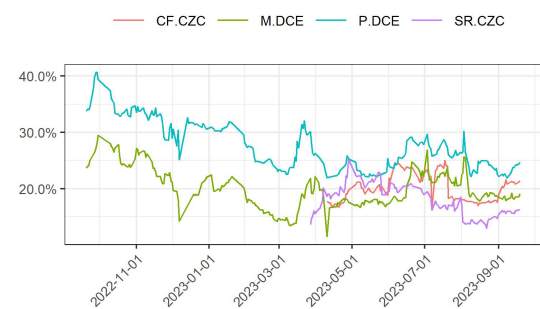


持仓量 PCR

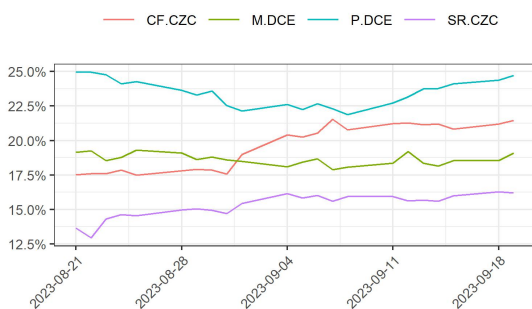


比值 PCR

三. 波动率



近 1 年隐含波动率



近 1 月隐含波动率

【金属】

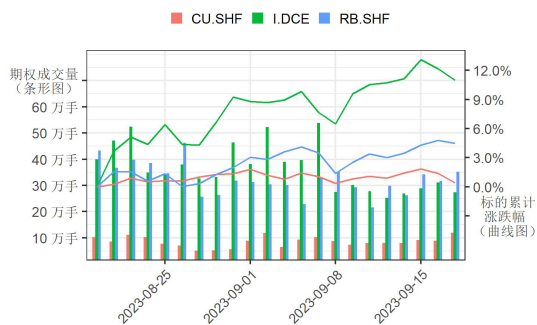
一. 行情简述

基本金属多数下跌，贵金属涨跌不一，黑色系多数上涨。螺纹钢跌 0.44%，铁矿石跌 0.63%。

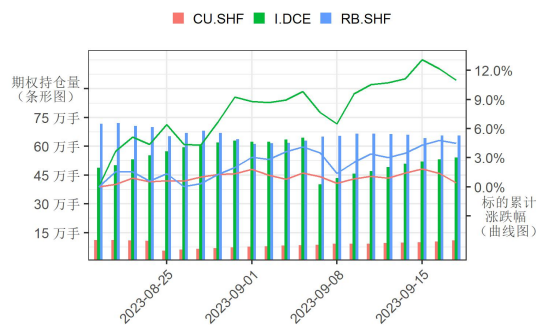


月行情

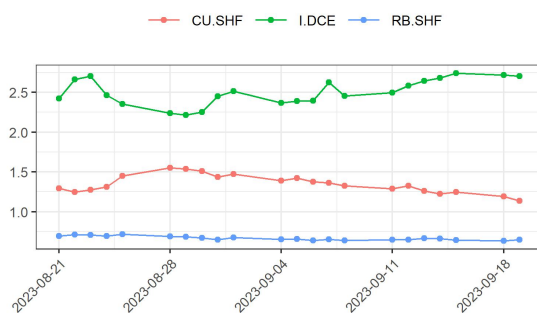
二. 期权成交持仓情况



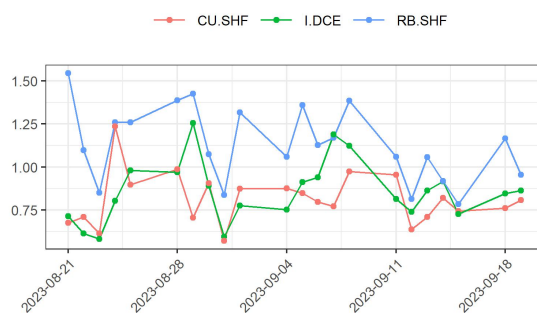
期权成交量



期权持仓量

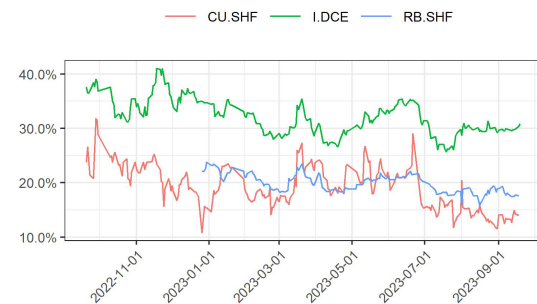


持仓量 PCR

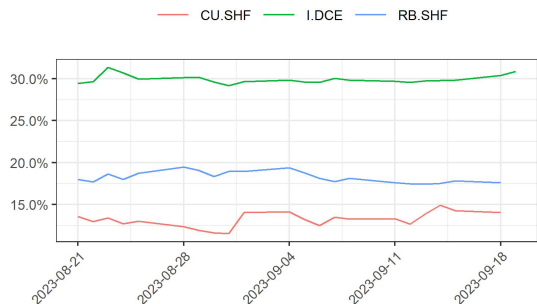


比值 PCR

三. 波动率



近 1 年隐含波动率



近 1 月隐含波动率

【能源化工】

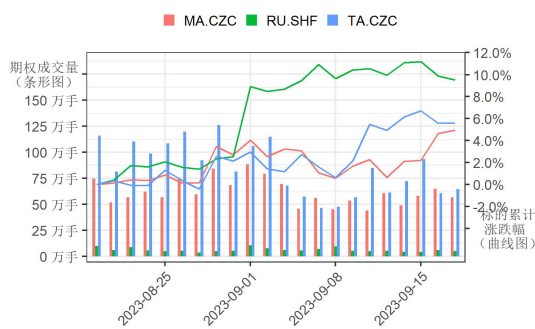
一. 行情简述

能化品涨跌不一。PTA 跌 0.22%，甲醇涨 0.04%，橡胶跌 0.25%。

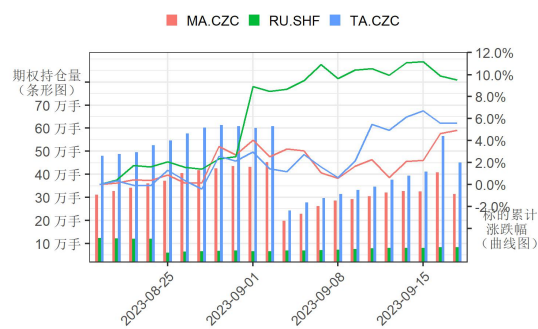


月行情

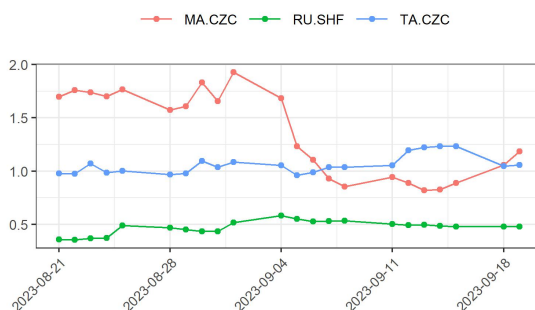
二. 期权成交持仓情况



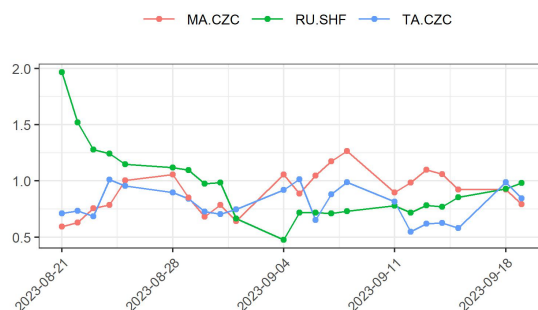
期权成交量



期权持仓量

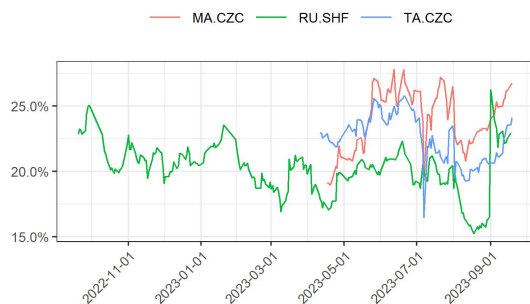


持仓量 PCR

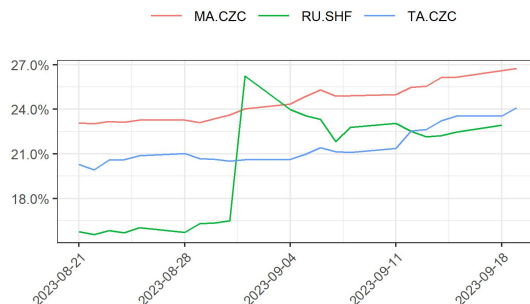


比值 PCR

三. 波动率



近 1 年隐含波动率



近 1 月隐含波动率

【以上内容所包含的所有数据、信息和观点仅供参考，并非建议或暗示任何投资决定，您据此所做的任何交易决定应自行负责，我公司不承担由此产生的任何责任。】