

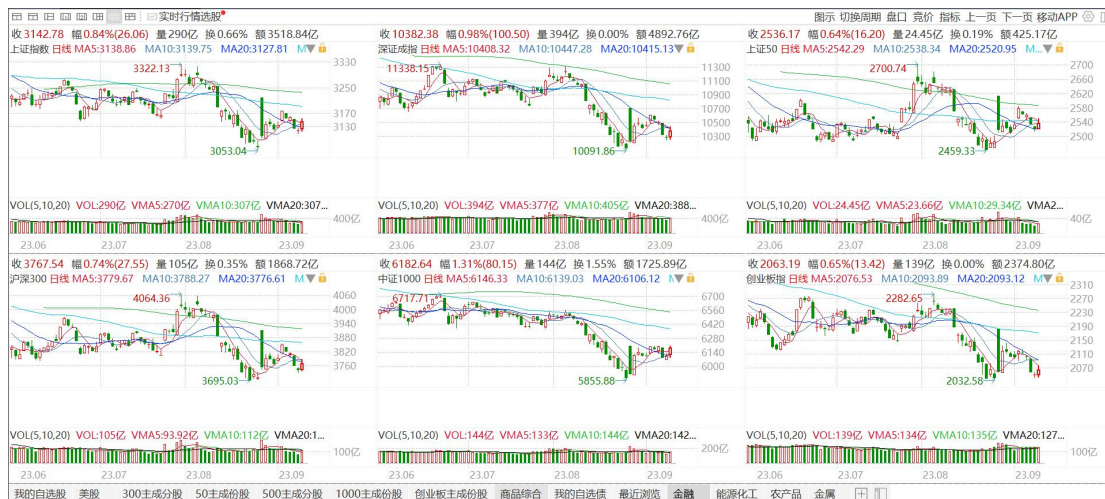
【策略建议】

品种	策略建议	策略逻辑
股指	买入 IO2310-P-3700 卖出 IO2310-P-3800	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	原油和煤炭价格坚挺，成本支撑仍在。上周上游工厂来看西北区域订单待发货量减少，企业库存及社会库存均呈累库趋势，下游需求暂时无明显利好支撑，宏观利好延续，甲醇价格震荡为主，布局双卖策略。
铜	买入 CU2311-C-68000 卖出 CU2311-C-69000	全球矿供应整体充裕，滞缓铜矿影响量有限，国内 9 月小幅检修，预计产量小幅减少，整体同比维持增量，需求端，铜材订单均有增加。进口窗口再关闭，国内库存减少，保税区去库趋稳，属于短期情况。临近交割预计近月升水走强，现货升水受到某种抑制，但是需求对升水有所抬升。后市延续国内复苏和产业旺季的共振上行。预计波动率震荡，布局牛市看涨价差。
棉花	卖出 CF2401-P-16800 卖出 CF2401-C-17800	受到美元走弱的提振，ICE 美棉期货周一上扬，同时美棉优良率再度下滑，低于上年同期，市场也在关注美农业部即将发布的月度供需报告；国内方面，在中储棉加量轮出并且宣布将在新棉采摘季继续轮出的消息后，储备棉昨日轮出成交率下滑，布局双卖策略。

【金融】

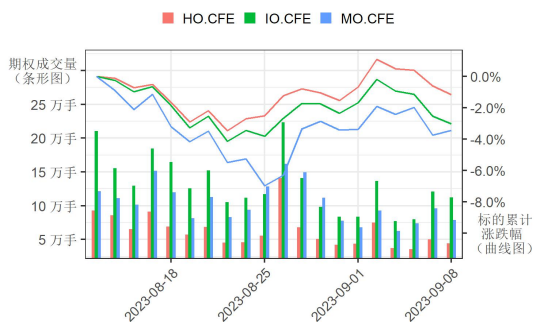
一. 行情简述

上证指数涨 0.84% 报 3142.78 点，深证成指涨 0.98%，创业板指涨 0.65%。A 股全天成交 8421.1 亿元，北向资金净买入 22.44 亿元。上证 50 涨 0.64% 报 2536 点，沪深 300 涨 0.74% 报 3767 点，中证 1000 涨 1.31% 报 6182 点，创业板指涨 0.65% 报 2063 点。

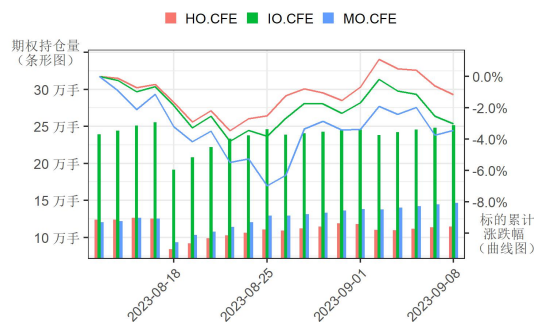


月行情

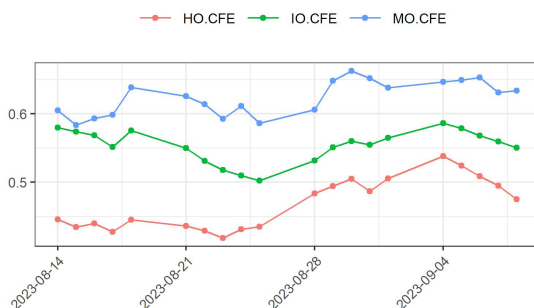
二. 期权成交持仓情况



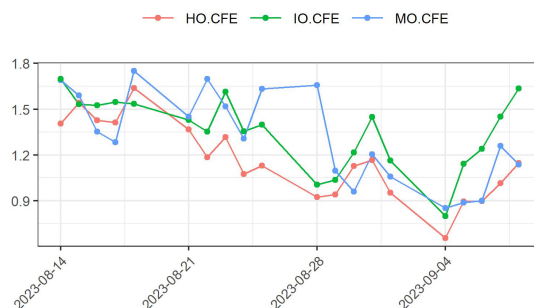
期权成交量——股指



期权持仓量——股指

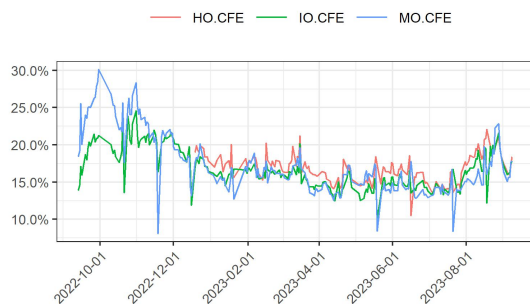


持仓量 PCR——股指

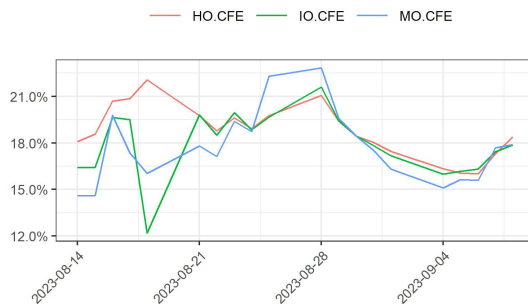


比值 PCR——股指

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】

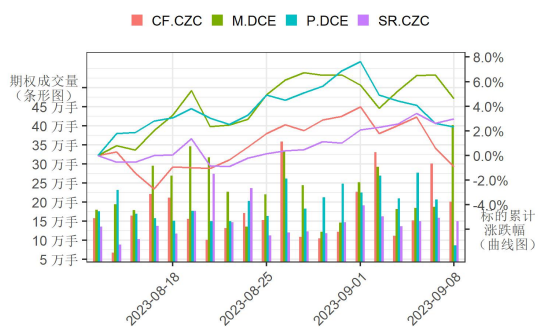
一. 行情简述

农产品涨跌不一。豆粕涨 0.32%，棕榈油跌 1.3%，棉花涨 0.5%，白糖跌 1.3%。

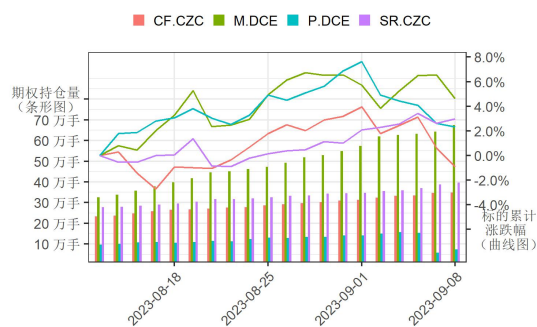


月行情

二. 期权成交持仓情况



期权成交量



期权持仓量



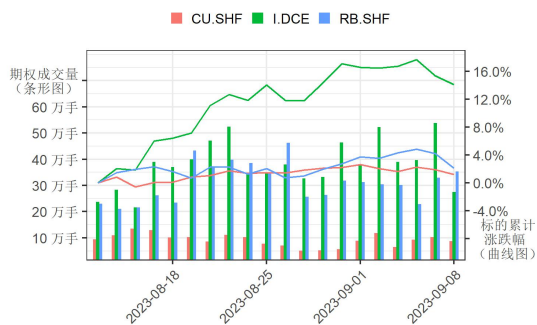
近 1 年隐含波动率



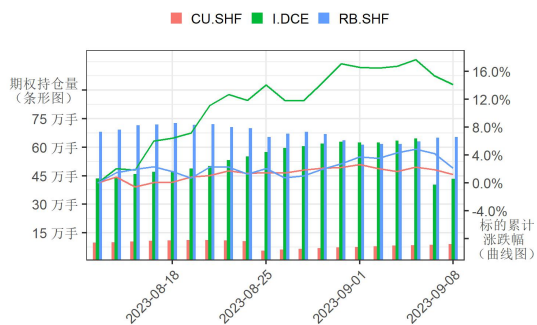
基本金属多数上涨，贵金属均上涨，黑色系领涨。铜涨 0.35%，螺纹钢涨 0.05%，铁矿石涨 1%。



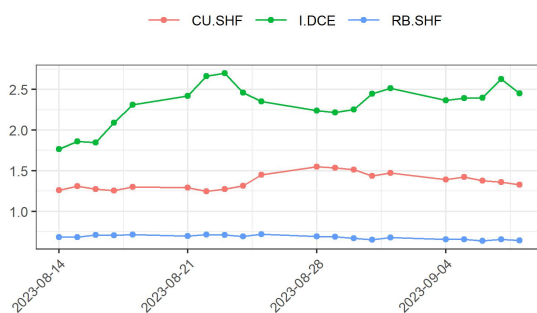
二. 期权成交持仓情况



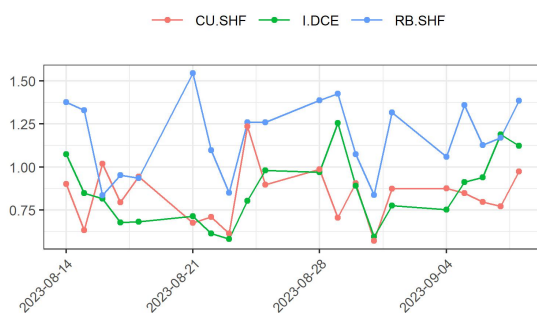
期权成交量



期权持仓量

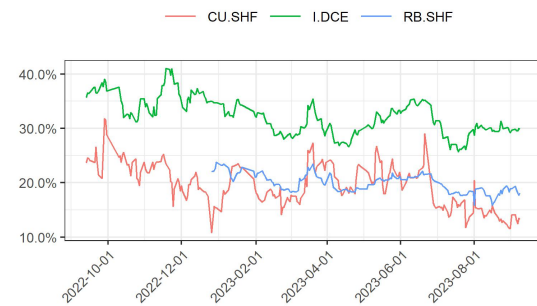


持仓量 PCR

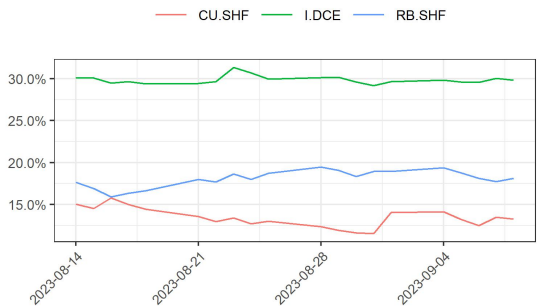


比值 PCR

三. 波动率



近 1 年隐含波动率



近 1 月隐含波动率

【能源化工】

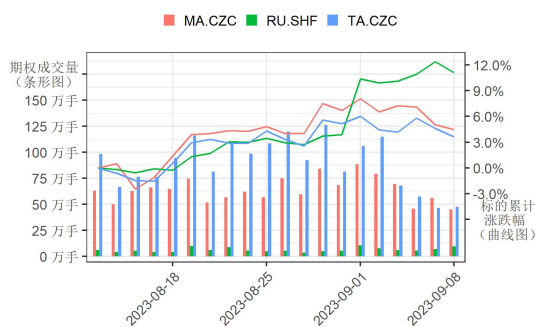
一. 行情简述

能化品多数上涨。PTA 涨 1.36%，甲醇涨 1.19%，橡胶跌 0.31%。

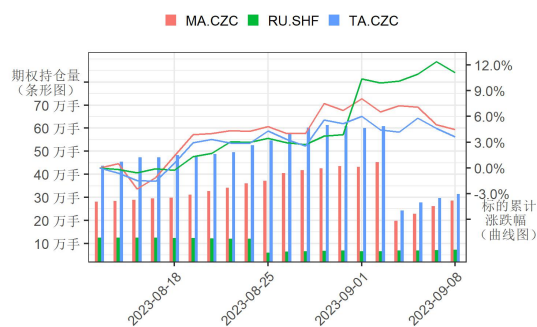


月行情

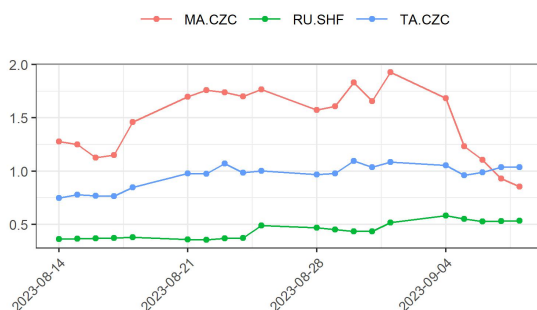
二. 期权成交持仓情况



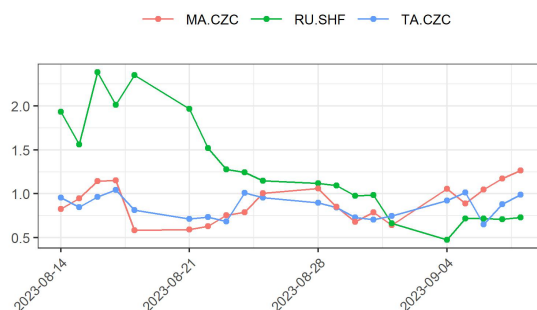
期权成交量



期权持仓量

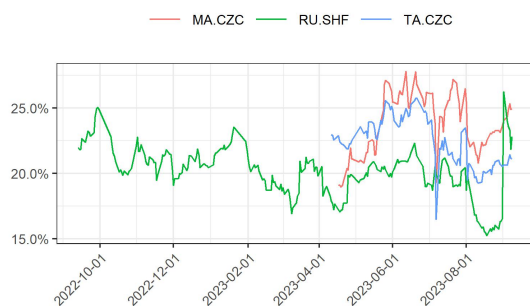


持仓量 PCR

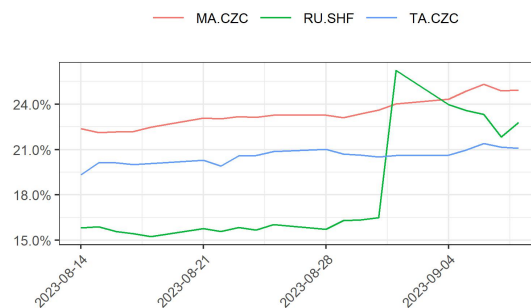


比值 PCR

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。】