

申万期权品种策略日报——上证50ETF期权										
2019/9/20 星期五										
申银万国期货研究所 吴广奇 (从业资格号: F3048078; 投资咨询号: Z0014024) wugq@sywgqh.com.cn 021-58308720										
一、标的行情										
	收盘价	涨跌幅	成交量 (亿)	成交额(亿 元)	30日历史 波动率	60日历史 波动率	90日历史波 动率			
上证50	2956.83	0.08%	20.94	348.47						
华夏上证 50ETF	3.0070	0.13%	3.94	11.83	14.39%	14.91%	15.97%			
二、当月合约基本信息										
合约月份	201910	剩余存续期 (交易日)	20	起始交易日期	2019-08-29	最后交易日 期	2019-10-23			
标的代码	510050.SH	标的收盘价	3.007							
三、50ETF期权行情										
当月认购期权				行权价格	当月认沽期权					
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量		
5,027	2,008	0.97%	0.3123	2.70	0.0029	-19.44%	5,710	28,613		
3,582	3,684	1.41%	0.2165	2.80	0.0068	-16.05%	10,413	43,549		
22,038	22,525	2.26%	0.1310	2.90	0.0200	-13.79%	45,560	70,979		
111,304	92,940	1.69%	0.0660	3.00	0.0550	-7.41%	72,616	89,291		
180,949	108,882	3.89%	0.0294	3.10	0.1186	-3.18%	29,834	40,465		
133,200	53,867	9.57%	0.0126	3.20	0.2014	-1.95%	10,594	18,958		
69,887	19,794	9.43%	0.0058	3.30	0.2950	-1.83%	3,696	3,974		
当月成交量认沽认购 比率			0.5766		当月持仓量认沽认购比 率			0.5276		
四、隐含波动率和期权杠杆率										
当月认购期权				行权价格	当月认沽期权					
期权杠杆率		隐含波动率			隐含波动率	期权杠杆率				
		9.57	0.00%	2.70	20.60%	-7.69				
		13.21	14.39%	2.80	18.11%	-22.38				
		18.54	15.81%	2.90	16.90%	-28.91				
		25.06	16.06%	3.00	16.92%	-24.60				
		28.29	17.02%	3.10	18.12%	-18.34				
		23.54	18.32%	3.20	19.84%	-13.46				
		12.84	19.97%	3.30	22.74%	-9.94				
五、希腊字母										
当月认购期权				行权价格	当月认沽期权					
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta		
-0.0832	0.0002	0.1495	0.9926	2.70	-0.0074	0.1495	0.0002	-0.0145		
-0.1439	0.0010	0.7594	0.9494	2.80	-0.0506	0.7594	0.0010	-0.0727		
-0.2599	0.0025	1.9937	0.8077	2.90	-0.1923	1.9937	0.0025	-0.1861		
-0.3319	0.0036	2.8864	0.5501	3.00	-0.4499	2.8864	0.0036	-0.2556		
-0.2669	0.0031	2.4402	0.2766	3.10	-0.7234	2.4402	0.0031	-0.1880		
-0.1353	0.0016	1.2672	0.0986	3.20	-0.9014	1.2672	0.0016	-0.0539		
-0.0445	0.0005	0.4228	0.0248	3.30	-0.9752	0.4228	0.0005	0.0394		

申万期权品种策略日报——白糖期货期权

一、标的行情

	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率
SR001	5437.00	0.04%	50.17	272.61	14.93%	15.88%	17.24%

二、主力月合约基本信息

合约月份	202001	剩余存续期(交易日)	50	起始交易日期	2019-01-18	最后交易日期	2019-12-04
标的代码	SR001	标的收盘价	5437.00				

三、白糖期货期权行情

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量
3,914	86	-6.32%	291.00	5,200.00	58.50	-1.69%	1,030	4,674
9,906	164	-1.12%	220.50	5,300.00	87.50	-1.12%	1,328	9,400
11,418	176	-4.50%	161.50	5,400.00	128.00	-4.18%	1,302	2,740
16,056	1,848	-7.50%	114.00	5,500.00	179.50	-1.36%	1,888	2,966
12,586	1,582	-7.65%	79.00	5,600.00	244.00	0.20%	28	1,424
13,670	2,686	-9.24%	54.50	5,700.00	318.50	3.72%	800	946
8,212	468	-12.20%	37.00	5,800.00	400.50	0.37%	34	798
主力月成交量认沽认购比率					主力月持仓量认沽认购比率			
1.2457					0.7534			

四、隐含波动率和期权杠杆率

主力月看涨期权			行权价格	主力月看跌期权	
期权杠杆率	隐含波动率	隐含波动率		期权杠杆率	
14.58	12.57%	5,200.00	15.23%	-24.53	
15.84	14.72%	5,300.00	15.09%	-21.55	
18.78	14.20%	5,400.00	14.60%	-19.28	
22.11	14.15%	5,500.00	14.99%	-16.27	
24.82	14.54%	5,600.00	15.52%	-13.90	
27.63	14.83%	5,700.00	17.17%	-11.74	
30.62	15.08%	5,800.00	16.16%	-10.66	

五、希腊字母

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta
-0.8513	7.9814	0.0008	0.7348	5,200.00	-0.2617	0.0008	7.9850	-0.8632
-0.9744	9.0901	0.0009	0.6454	5,300.00	-0.3507	0.0009	9.0904	-0.9814
-1.0423	9.7436	0.0010	0.5491	5,400.00	-0.4469	0.0010	9.7436	-1.0442
-1.0462	9.8328	0.0010	0.4515	5,500.00	-0.5445	0.0010	9.8324	-1.0431
-0.9893	9.3430	0.0009	0.3584	5,600.00	-0.6378	0.0009	9.3406	-0.9810
-0.8843	8.3593	0.0008	0.2745	5,700.00	-0.7221	0.0008	8.3519	-0.8710
-0.7495	7.0423	0.0007	0.2027	5,800.00	-0.7943	0.0007	7.0259	-0.7314

申万期权品种策略日报——棉花期货期权

一、标的行情

	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率
CF001	12890.00	-0.66%	25.40	163.80	16.69%	19.18%	20.84%

二、主力月合约基本信息

合约月份	202001	剩余存续期(交易日)	50	起始交易日期	2019-05-24	最后交易日期	2019-12-04
标的代码	CF001	标的收盘价	12890.00				

三、棉花期货期权行情

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量
294	14	-6.44%	936.00	12,200.00	240.00	5.36%	1,794	5,318
1,976	2	-5.27%	797.00	12,400.00	300.00	5.65%	416	5,232
454	30	-9.50%	673.00	12,600.00	375.00	7.93%	6	2,844
3,006	326	-10.64%	563.00	12,800.00	463.00	6.18%	64	1,870
2,546	74	-11.00%	466.00	13,000.00	565.00	6.18%	58	3,040
3,742	200	-12.29%	382.00	13,200.00	680.00	2.01%	4	820
876	82	-12.50%	312.00	13,400.00	808.00	4.39%	0	320
876	82	-12.50%	312.00	13,400.00	808.00	4.39%	0	320
主力月成交量认沽认购比率					主力月持仓量认沽认购比率			
1.2215					0.9904			

四、隐含波动率和期权杠杆率

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权	
期权杠杆率		隐含波动率			隐含波动率	期权杠杆率
	10.05	22.63%		12,200.00	22.29%	-14.83
	10.64	23.12%		12,400.00	22.12%	-14.16
	11.92	21.63%		12,600.00	22.21%	-13.14
	12.88	21.44%		12,800.00	21.77%	-12.51
	13.76	21.52%		13,000.00	21.71%	-11.65
	14.69	21.59%		13,200.00	20.72%	-11.20
	15.26	22.00%		13,400.00	21.65%	#DIV/0!
	16.00	22.06%		13,600.00	22.24%	-9.20

五、希腊字母

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta
-2.7363	19.7081	0.0003	0.7248	12,200.00	-0.2716	0.0003	19.7201	-2.7711
-2.9916	21.3913	0.0003	0.6678	12,400.00	-0.3284	0.0003	21.3955	-3.0164
-3.1790	22.5981	0.0003	0.6076	12,600.00	-0.3884	0.0003	22.5992	-3.1937
-3.2883	23.2391	0.0003	0.5457	12,800.00	-0.4503	0.0003	23.2393	-3.2929
-3.3158	23.2656	0.0003	0.4836	13,000.00	-0.5124	0.0003	23.2655	-3.3103
-3.2622	23.1308	0.0003	0.4228	13,200.00	-0.5732	0.0003	23.1284	-3.2465
-3.1352	22.2415	0.0003	0.3647	13,400.00	-0.6315	0.0003	22.2370	-3.1094
-2.9478	20.8214	0.0003	0.3104	13,600.00	-0.6860	0.0003	20.8123	-2.9119

申万期权品种策略日报——天然橡胶期货期权

一、标的行情

	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率
RU1905	11815.00	-0.01	30.36	361.40	0.00%	0.00%	0.00%

二、主力月合约基本信息

合约月份	202001	剩余存续期(交易日)	65	起始交易日期	2019-01-28	最后交易日	2019-12-25
标的代码	RU2001	标的收盘价	11815				

三、天然橡胶期货期权行情

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量
896	10	-7.94%	845.00	11,500.00	446.00	-11.27%	20	1,594
468	8	-19.36%	710.00	11,750.00	561.00	-6.81%	54	244
2,058	180	-21.81%	591.00	12,000.00	691.00	-2.44%	36	418
504	40	-22.86%	487.00	12,250.00	836.00	-0.75%	4	134
962	102	-28.64%	397.00	12,500.00	995.00	-5.64%	10	122
530	34	-22.74%	320.00	12,750.00	1,168.00	-4.34%	28	188
3,320	644	-20.39%	256.00	13,000.00	1,353.00	4.80%	18	112
942	52	-16.42%	203.00	13,250.00	1,549.00	2.72%	24	44
2,390	52	-9.55%	159.00	13,500.00	1,755.00	-0.18%	4	64
842	12	-3.31%	124.00	13,750.00	1,969.00	2.23%	0	60
2,404	298	6.45%	95.00	14,000.00	2,190.00	-0.09%	10	42
主力月成交量看跌看涨比率					主力月持仓量看跌看涨比率			
0.3657					0.4329			

四、隐含波动率和期权杠杆率

主力月看涨期权			行权价格	主力月看跌期权	
期权杠杆率	隐含波动率	隐含波动率		期权杠杆率	
9.00	26.03%	11,500.00	21.45%	-12.60	
11.04	22.65%	11,750.00	21.76%	-10.88	
12.21	22.69%	12,000.00	22.27%	-9.48	
13.24	23.06%	12,250.00	22.30%	-8.51	
15.34	22.49%	12,500.00	19.64%	-8.20	
15.11	24.04%	12,750.00	18.97%	-7.43	
15.71	24.57%	13,000.00	24.19%	-6.24	
15.97	25.20%	13,250.00	22.34%	-5.87	
15.75	26.10%	13,500.00	17.03%	-5.58	
15.76	26.52%	13,750.00	20.03%	-5.05	
15.21	27.35%	14,000.00	0.00%	-4.79	

五、希腊字母

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta
-3.2432	23.2962	0.0002	0.6005	11,500.00	-0.3944	0.0002	23.2958	-3.2589
-3.3440	24.0241	0.0002	0.5409	11,750.00	-0.4540	0.0002	24.0239	-3.3472
-3.3676	24.1167	0.0002	0.4815	12,000.00	-0.5134	0.0002	24.1171	-3.3583
-3.3179	23.5681	0.0002	0.4238	12,250.00	-0.5713	0.0002	23.5680	-3.2963
-3.2010	23.1764	0.0002	0.3686	12,500.00	-0.6266	0.0002	23.1673	-3.1669
-3.0272	21.7506	0.0002	0.3172	12,750.00	-0.6782	0.0002	21.7379	-2.9809
-2.8123	19.8726	0.0002	0.2699	13,000.00	-0.7259	0.0002	19.8527	-2.7538
-2.5685	18.8904	0.0002	0.2271	13,250.00	-0.7692	0.0002	18.8245	-2.4980
-2.3071	16.5756	0.0002	0.1893	13,500.00	-0.8074	0.0002	16.5019	-2.2248
-2.0414	14.1602	0.0001	0.1560	13,750.00	-0.8413	0.0001	14.0699	-1.9474
-1.7804	13.0113	0.0001	0.1274	14,000.00	-0.8705	0.0001	12.8401	-1.6749

申万期权品种策略日报——铜期货期权

一、标的行情

	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率
CU1911	47070	-0.38%	11.07	260.81	0.00%	0.00%	0.00%

二、主力月合约基本信息

合约月份	201911	剩余存续期(交易日期)	22	起始交易日期	2018-11-16	最后交易日期	2019-10-25
标的代码	CU1911	标的收盘价	47070.00				

三、铜期货期权行情

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量
220	180	-5.75%	2,261	45,000	134	-34.75%	794	2,040
420	196	-12.18%	1,473	46,000	345	-26.37%	608	1,918
936	436	-21.69%	858	47,000	728	-11.16%	520	1,126
1,686	1,104	-26.04%	439	48,000	1,308	-1.30%	306	420
3,332	938	-21.66%	195	49,000	2,062	3.21%	384	614
2,100	1,082	-7.06%	75	50,000	2,940	2.69%	58	166
2,586	924	53.57%	24	51,000	3,888	2.89%	104	220
2,150	934	262.50%	7	52,000	4,869	2.36%	50	114
当月成交量认沽认购比率					当月持仓量认沽认购比率			
0.5855					0.7847			

四、隐含波动率和期权杠杆率

主力月看涨期权			行权价格	主力月看跌期权	
期权杠杆率	隐含波动率	隐含波动率		期权杠杆率	
19.52	14.12%	45,000	11.23%	-44.81	
26.50	12.28%	46,000	10.73%	-46.52	
34.15	11.71%	47,000	10.77%	-37.34	
35.90	12.26%	48,000	10.90%	-28.20	
28.37	13.08%	49,000	11.09%	-20.78	
16.66	13.87%	50,000	0.00%	-15.70	
6.01	15.10%	51,000	0.00%	-12.03	
1.27	16.75%	52,000	0.00%	-9.65	

五、希腊字母

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta
-2.7017	20.5522	0.0001	0.9242	45,000	-0.0733	0.0001	20.5522	-2.8460
-6.0718	44.4319	0.0002	0.7712	46,000	-0.2263	0.0002	44.4319	-6.1464
-8.0960	58.7084	0.0003	0.5239	47,000	-0.4736	0.0003	58.7084	-8.1009
-6.7608	48.8860	0.0002	0.2708	48,000	-0.7267	0.0002	48.8860	-6.6960
-3.6539	26.3910	0.0001	0.1025	49,000	-0.8950	0.0001	26.3910	-3.5194
-1.3136	9.4824	0.0000	0.0280	50,000	-0.9695	0.0000	9.4824	-1.1093
-0.3220	2.3235	0.0000	0.0055	51,000	-0.9920	0.0000	2.3235	-0.0480
-0.0550	0.3972	0.0000	0.0008	52,000	-0.9967	0.0000	0.3972	0.2886
-0.0067	0.0484	0.0000	0.0001	53,000	-0.9974	0.0000	0.0484	0.4067

申万期权品种策略日报——豆粕期货期权									
一、标的行情									
	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率		
M1905	2862.00	0.10%	135.37	387.95	15.87%	14.29%	16.26%		
二、主力月合约基本信息									
合约月份	202001	剩余存续期(交易日)	52	起始交易日期	2019-02-01	最后交易日期	2019-12-06		
标的代码	M2001	标的收盘价	2862						
三、豆粕期货期权行情									
主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权				
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量	
2,058	220	4.91%	320.50	2,550.00	6.50	-60.00%	1,982	6,996	
600	96	2.03%	275.50	2,600.00	11.00	-69.23%	1,982	11,020	
726	52	3.92%	232.50	2,650.00	18.00	-64.29%	11,622	45,460	
1,138	464	-3.15%	193.00	2,700.00	28.50	-53.13%	12,040	46,606	
3,668	928	-4.52%	157.00	2,750.00	42.00	-40.86%	8,318	13,724	
3,950	1,830	-6.45%	125.00	2,800.00	60.00	-26.92%	8,682	15,484	
10,200	2,140	-7.25%	97.00	2,850.00	82.00	-17.05%	3,336	13,646	
14,722	4,350	-3.38%	74.00	2,900.00	108.50	-11.30%	2,130	11,724	
12,984	3,398	0.90%	55.00	2,950.00	139.50	-6.16%	682	4,756	
13,532	4,290	8.64%	39.50	3,000.00	174.50	-3.04%	756	4,392	
19,978	2,802	20.69%	28.00	3,050.00	212.50	-4.56%	486	2,400	
28,688	8,050	37.50%	19.50	3,100.00	254.00	-1.34%	266	2,132	
主力月成交量看跌看				0.7625	主力月持仓量看跌看涨				0.9615
四、隐含波动率和期权杠杆率									
主力月看涨期权			行权价格	主力月看跌期权					
期权杠杆率	隐含波动率			隐含波动率	期权杠杆率				
	8.2209	23.13%	2,550.00	14.40%	-45.4795				
	9.4723	18.73%	2,600.00	13.17%	-58.5429				
	10.4064	19.58%	2,650.00	12.85%	-49.7629				
	12.4461	15.48%	2,700.00	13.11%	-37.1126				
	13.9808	15.56%	2,750.00	13.49%	-28.4481				
	15.6023	15.63%	2,800.00	14.28%	-21.9088				
	17.1253	15.88%	2,850.00	15.01%	-18.0471				
	17.5408	16.86%	2,900.00	15.46%	-15.6482				
	17.6827	17.51%	2,950.00	16.19%	-13.5817				
	17.1305	18.16%	3,000.00	16.90%	-11.9562				
	15.7950	18.88%	3,050.00	15.63%	-10.9827				
	14.2313	19.47%	3,100.00	17.37%	-9.5894				
五、希腊字母									
主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权				
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta	
-0.1137	1.3262	0.0005	0.9522	2,550.00	-0.0477	0.0005	1.3939	-0.1288	
-0.1831	1.9850	0.0008	0.9168	2,600.00	-0.0818	0.0007	2.0184	-0.1959	
-0.2640	2.7373	0.0011	0.8672	2,650.00	-0.1304	0.0010	2.7518	-0.2745	
-0.3481	3.5271	0.0014	0.8023	2,700.00	-0.1945	0.0014	3.5322	-0.3562	
-0.4241	4.4679	0.0016	0.7230	2,750.00	-0.2733	0.0016	4.4714	-0.4297	
-0.4806	4.9866	0.0019	0.6324	2,800.00	-0.3636	0.0018	4.9871	-0.4838	
-0.5094	5.2372	0.0020	0.5355	2,850.00	-0.4603	0.0020	5.2372	-0.5100	
-0.5071	5.1784	0.0019	0.4382	2,900.00	-0.5577	0.0019	5.1784	-0.5051	
-0.4757	4.8209	0.0018	0.3460	2,950.00	-0.6501	0.0018	4.8204	-0.4713	
-0.4219	4.2262	0.0016	0.2634	3,000.00	-0.7332	0.0016	4.2236	-0.4150	
-0.3548	3.7532	0.0014	0.1932	3,050.00	-0.8039	0.0014	3.7371	-0.3454	
-0.2836	2.9759	0.0011	0.1367	3,100.00	-0.8611	0.0011	2.9526	-0.2719	

申万期权品种策略日报——玉米期货期权

一、标的行情

	收盘价	涨跌幅	成交量(万手)	成交额(亿元)	30日历史波动率	60日历史波动率	90日历史波动率
C2001	1864.00	-0.38%	11.07	260.81	8.62%	7.35%	8.75%

二、主力月合约基本信息

合约月份	202001	剩余存续期(交易日)	52	起始交易日期	2019-01-28	最后交易日期	2019-12-06
标的代码	C2001	标的收盘价	1864				

三、玉米期货期权行情

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
持仓量	成交量	涨跌幅(%)	结算价		结算价	涨跌幅(%)	成交量	持仓量
496	60	-4.52%	112.50	1,760.00	1.00	-16.67%	386	1,618
558	196	-8.60%	93.50	1,780.00	2.00	-30.00%	1,050	3,386
1,248	508	-11.11%	76.00	1,800.00	4.00	-35.29%	2,348	7,958
1,632	624	-18.03%	59.50	1,820.00	7.50	-44.44%	854	6,106
2,188	1,290	-27.37%	44.50	1,840.00	12.50	-42.50%	2,144	16,388
16,634	20,084	-38.89%	32.00	1,860.00	20.00	-33.93%	5,590	25,720
31,018	21,348	-49.06%	22.00	1,880.00	30.00	-20.78%	734	8,042
36,486	22,426	-55.26%	14.50	1,900.00	42.50	-10.89%	692	5,810
13,430	7,074	-53.85%	9.00	1,920.00	57.00	-5.38%	602	4,586
10,124	2,032	-52.94%	5.00	1,940.00	73.00	1.86%	228	2,936
10,826	2,158	-27.27%	2.50	1,960.00	90.50	4.12%	294	3,088
39,046	9,420	16.67%	1.50	1,980.00	109.00	4.78%	244	3,584
22,708	1,258	25.00%	0.50	2,000.00	128.50	4.49%	82	2,558
主力月成交量看跌看					主力月持仓量看跌看涨			
0.1699					0.4151			

四、隐含波动率和期权杠杆率

主力月看涨期权			行权价格	主力月看跌期权	
期权杠杆率	隐含波动率	隐含波动率		期权杠杆率	
16.0840	8.07%	8.72%	-65.7567		
18.8594	6.28%	8.06%	-73.2582		
21.7767	7.00%	7.67%	-68.5933		
26.6406	6.30%	6.83%	-70.0112		
33.6935	5.98%	6.28%	-60.3559		
44.5881	5.82%	5.96%	-47.3156		
59.1378	5.95%	6.27%	-34.6891		
73.5762	6.34%	6.57%	-27.3648		
78.4719	7.01%	6.88%	-22.5489		
85.0759	7.47%	8.66%	-18.5171		
58.9887	8.78%	9.54%	-16.0814		
44.8148	9.68%	10.59%	-14.1509		
40.0177	10.03%	11.18%	-12.6467		

五、希腊字母

主力月看涨期权				行权价格	主力月看跌期权			
Theta	Vega	Gamma	Delta		Delta	Gamma	Vega	Theta
-0.0773	1.3229	0.0020	0.9103	1,760.00	-0.0882	0.0020	1.3408	-0.0824
-0.1091	1.8129	0.0028	0.8600	1,780.00	-0.1376	0.0027	1.8210	-0.1132
-0.1418	2.4824	0.0035	0.7944	1,800.00	-0.2024	0.0035	2.4885	-0.1450
-0.1711	2.9352	0.0042	0.7146	1,820.00	-0.2817	0.0042	2.9369	-0.1733
-0.1925	3.2637	0.0047	0.6236	1,840.00	-0.3724	0.0047	3.2639	-0.1937
-0.2029	3.4158	0.0049	0.5263	1,860.00	-0.4696	0.0049	3.4158	-0.2031
-0.2007	3.3661	0.0049	0.4283	1,880.00	-0.5676	0.0049	3.3661	-0.1999
-0.1869	3.1235	0.0045	0.3355	1,900.00	-0.6606	0.0045	3.1230	-0.1851
-0.1641	2.7294	0.0040	0.2526	1,920.00	-0.7440	0.0040	2.7271	-0.1613
-0.1361	2.2459	0.0033	0.1826	1,940.00	-0.8146	0.0033	2.2400	-0.1324
-0.1069	1.7402	0.0026	0.1266	1,960.00	-0.8714	0.0026	1.7282	-0.1022
-0.0796	1.2697	0.0019	0.0841	1,980.00	-0.9148	0.0020	1.2486	-0.0739
-0.0563	0.9966	0.0014	0.0537	2,000.00	-0.9465	0.0014	0.9484	-0.0497

免责声明

本报告的信息均来源于公开资料，本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，报告中的信息或意见并不构成所述品种的买卖出价，投资者据此做出的任何投资决策与本公司无关。

本报告所涵括的信息仅供交流研讨，投资者应合理合法使用本报告所提供的信息、建议，不得用于未经允许的其他任何用途。如因投资者将本报告所提供的信息、建议用于非法目的，所产生的一切经济、法律责任均与本公司无关。

本报告的版权归本公司所有。本公司对本报告保留一切权利，未经本公司书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为申银万国期货，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。