

【核心观点】

上证50ETF: 昨收2.977, 涨幅0.85%, 日成交量 553万手, 环比增幅为-44.82%。

50ETF期权: 昨日成交 178万张(最近一年日均成交约 246万张), 比前日增加了-41.79%; 成交量pcr为0.84, 比前日走高0.21; 持仓量为 254万张, 比前日增加了9.88%, 其中认沽期权 121万张, 认购期权 133万张, pcr为0.90, 比前日走高0.06。

8月期权合约还剩24个交易日。

【操作建议】

如果出现震荡行情且隐波下行, 则卖出跨式; 如出现趋势可以买入对应期权或卖出反向期权。

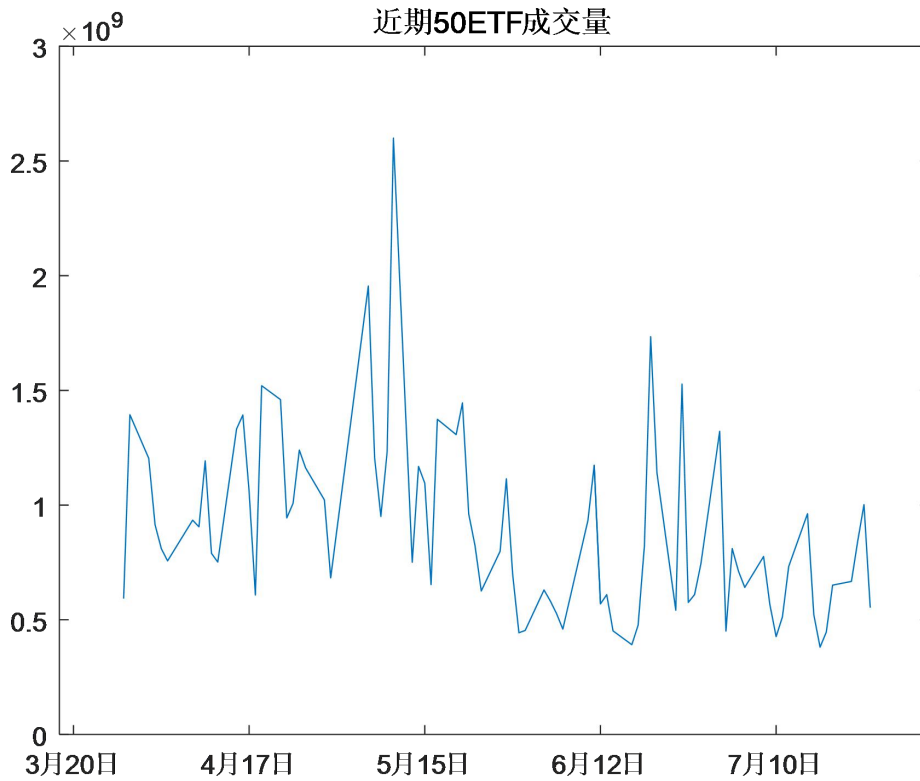


图 1 成交量过千万

认购													全部	认沽												
最新价	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量	日持仓	持仓波动	Delta	Gamma	Vega	Theta	Rho	行权价	最新价	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量	日持仓	持仓波动	Delta	Gamma	Vega	Theta	Rho		
2019年08月(到期日2019-08-28, 剩余34个自然日, 24个交易日, 合约乘数10000)																										
0.2821	0.0216	8.29%	6661	7506	+585	0.00%	0.9402	0.6068	0.0011	-0.0005	0.0024	2.700	0.0037	-0.0013	-26.00%	4.32万	89532	+3731	19.73%	-0.0598	0.6068	0.0011	-0.0003	-0.0002		
0.2345	0.0204	8.53%	4746	11463	-75	12.01%	0.8993	0.9012	0.0016	-0.0007	0.0023	2.750	0.0055	-0.0029	-34.52%	4.13万	74690	+3482	18.36%	-0.1007	0.9012	0.0016	-0.0005	-0.0003		
0.1893	0.0183	10.70%	1.31万	15733	+625	14.93%	0.8422	1.2319	0.0022	-0.0008	0.0022	2.800	0.0100	-0.0051	-33.77%	6.12万	101650	+18663	17.93%	-0.1578	1.2319	0.0022	-0.0006	-0.0005		
0.1466	0.0144	10.89%	3.24万	38319	-209	15.43%	0.7686	1.5566	0.0028	-0.0010	0.0020	2.850	0.0182	-0.0083	-31.32%	7.46万	91878	+21312	17.88%	-0.2314	1.5566	0.0028	-0.0008	-0.0007		
0.1106	0.0111	11.16%	9.17万	76942	-3737	16.33%	0.6808	1.8253	0.0033	-0.0011	0.0018	2.900	0.0306	-0.0122	-28.50%	12.96万	118549	+21719	17.68%	-0.3192	1.8253	0.0033	-0.0009	-0.0010		
0.0798	0.0073	10.07%	22.26万	140497	-7327	16.68%	0.5831	1.9940	0.0036	-0.0012	0.0016	2.950	0.0495	-0.0163	-24.77%	17.08万	125628	+36672	17.87%	-0.4169	1.9940	0.0036	-0.0010	-0.0012		
0.0558	0.0038	7.31%	18.70万	158329	+6072	17.16%	0.4817	2.0382	0.0037	-0.0012	0.0013	3.000	0.0752	-0.0198	-20.84%	8.53万	60346	+13664	18.21%	-0.5183	2.0382	0.0037	-0.0010	-0.0016		
0.0249	-0.0001	-0.40%	13.60万	169134	+23612	18.01%	0.2930	1.7574	0.0032	-0.0010	0.0008	3.100	0.1448	-0.0231	-13.76%	2.41万	28262	+1616	19.53%	-0.7070	1.7574	0.0032	-0.0008	-0.0022		
0.0104	-0.0003	-2.80%	7.39万	135216	+18535	18.98%	0.1521	1.2023	0.0022	-0.0007	0.0004	3.200	0.2297	-0.0252	-9.89%	7145	12745	-1297	21.16%	-0.8479	1.2023	0.0022	-0.0005	-0.0026		
0.0047	-0.0007	-12.96%	3.63万	82865	+10281	20.53%	0.0674	0.6662	0.0012	-0.0004	0.0002	3.300	0.3238	-0.0242	-6.95%	1579	1900	+42	23.71%	-0.9326	0.6662	0.0012	-0.0001	-0.0030		
0.0028	-0.0007	-20.00%	2.46万	57812	+6612	22.80%	0.0256	0.3047	0.0005	-0.0002	0.0001	3.400	0.4219	-0.0261	-5.83%	748	2205	+12	26.54%	-0.9744	0.3047	0.0005	0.0001	-0.0032		

图 2

重要声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，国元期货力求准确可靠，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。

联系我们 全国统一客服电话：400-8888-218

国元期货总部

地址：北京东城区东直门外大街 46 号天恒大厦 B 座 21 层

电话：010-84555000

合肥分公司

地址：合肥市金寨路 329 号国轩凯旋大厦 4 层（合肥师范学院旁）

电话：0551-68115908

福建分公司

地址：福建省厦门市思明区莲岳路 1 号 2204 室之 01 室（即磐基商务楼 2501 室）

电话：0592-5312522

通辽营业部

地址：内蒙古通辽市科尔沁区建国路 37 号世基大厦 12 层

电话：0475-6380818

大连分公司

地址：大连市沙河口区会展路 129 号国际金融中心 A 座期货大厦 2407、2406B。

电话：0411-84807840

青岛营业部

地址：青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 9 层 901 室

电话 0532-66728681

郑州营业部

地址：郑州市金水区未来路 69 号未来大厦 1410 室

电话：0371-53386892/53386809

上海营业部

地址：上海浦东新区松林路 300 号 2002 室

电话：021-68400292

合肥营业部

地址：合肥市庐阳区国轩凯旋大厦四层（合肥师范学院旁）

电话：0551-68115906、0551-68115888

合肥金寨路营业部

地址：安徽省合肥市蜀山区金寨路 91 号立基大厦 A 座六楼

电话：0551-62895501

西安分公司

地址：陕西省西安市雁塔区二环南路西段 64 号凯德广场西塔 6 层 06 室

电话：029-88604088

重庆营业部

地址：重庆市江北区观音桥步行街融恒时代广场 14-6

电话：023-67107988

厦门营业部

地址：福建省厦门市思明区莲岳路 1 号磐基中心 1707-1708 室

电话：0592-5312522

深圳营业部

地址：深圳市福田区园岭街道百花二路 48 号二层（深圳实验小学对面）

电话：0755-82891269

唐山营业部

地址：唐山市路北区北新西道 24 号中环商务 20 层 2003-2005 室

电话：0315-5105115

龙岩营业部

地址：福建省龙岩市龙岩大道商务板块 E 栋 1302

电话：0597-2529256

杭州营业部

地址：浙江省杭州市滨江区江汉路 1785 号网新双城大厦 4 幢 2201-3 室

电话：0571-87686300

宝鸡营业部

地址：陕西省宝鸡市金台区陈仓园金九商务楼 9 层 920、921 室

电话：0917-3859933