

商品期权策略周报

研究中心 2021.10.31

撰写：王文科（投资咨询从业证书号Z0013661）

联系：0571-87219375



场内期权





- **策略操作:** 卖出P2201-P-9000 , 收入权利金为290
- **行情走势:** 上周棕榈油在回调后继续上涨
- **策略收益分析:** 当前组合权利金为179, 收益率**12%**
- **后续操作建议:** 可继续持有

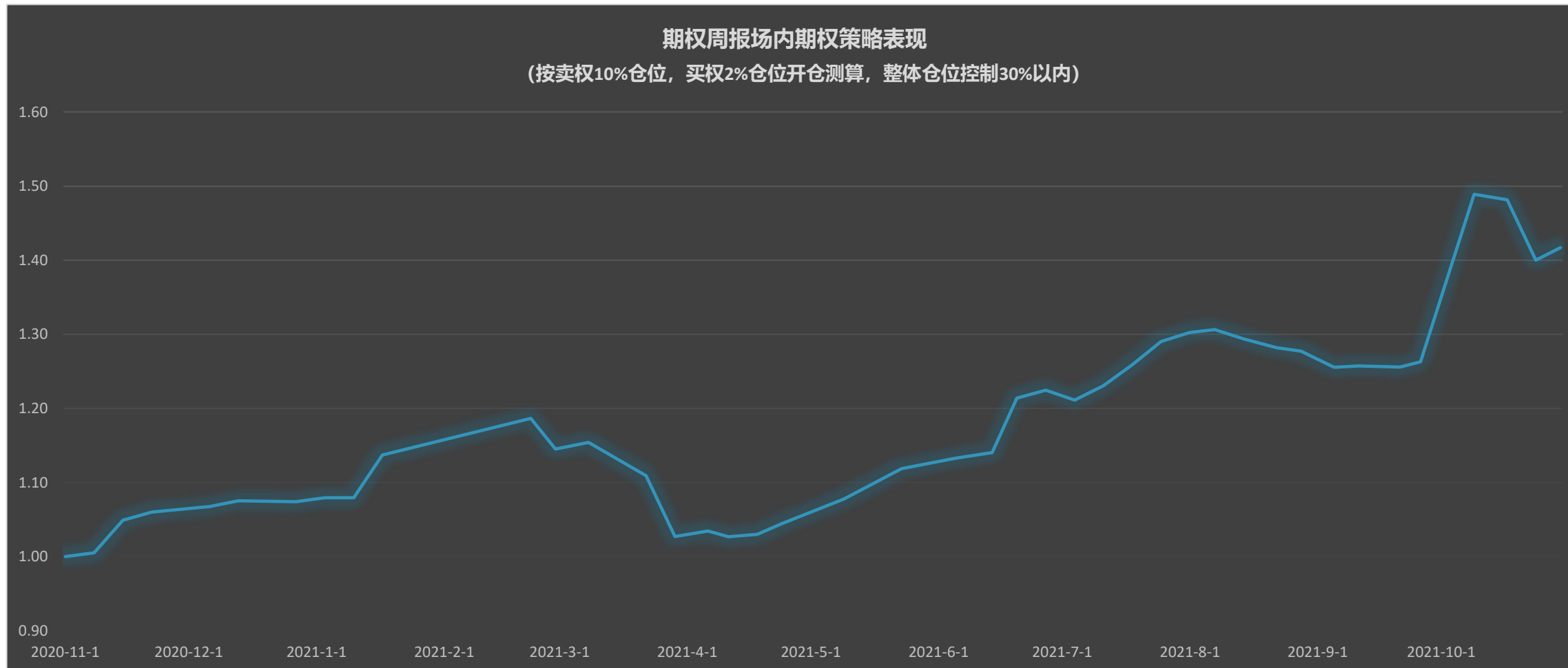


■ 卖出MA201P2500

- 逻辑: 甲醇在大幅回调后企稳反弹, 同时当前甲醇波动率较高, 可卖出期权
- 风险: 商品整体下跌风险
- 测算: 权利金收入为40元/吨, 保证金为200元/吨, 离到期还有33天

报告历史业绩回测效果





注: 回测仅代表报告过去所提策略的表现, 不代表未来报告策略的效果; 投资有风险,入市需谨慎。

免责声明：

本报告版权归“浙商期货”所有，未经事先书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“浙商期货”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。本报告基于我公司及其研究人员认为可信的公开资料或实地调研资料，但我公司及其研究人员对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的信息或所表达意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，我公司不就报告中的内容对最终操作建议做出任何担保。我公司的关联机构或个人可能在本报告公开发布前已使用或了解其中信息。

