

2013年Q4

電子期權聚焦

在CME Globex訪問不斷增長的期權流動性

期貨期權繼續顯示出電子增長和強勁表現。芝商所上市的期貨期權延伸配套產品提供您實現您的交易目標（從簡至繁）所需的流動性、靈活性和市場深度。本文檔旨在提供涵蓋所有資產類別的電子趨勢及機會的季度快報。

利率

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
歐洲美元/中期曲線 ¹	GE, GEO, GE2, GE3, GE4	599,949	\$597,992	17,330,190	11%	↑1%
10年期國債 ²	OZN	360,416	\$36,042	1,654,367	57%	↑6%
5年期國債 ²	OZF	86,243	\$8,624	811,877	49%	↑9%
美國國債 ²	OZB	61,492	\$6,149	354,267	73%	↑7%
2年期國債 ²	OZT	4,503	\$901	22,981	41%	↑10%

¹ 這些合約按照CME規則和條例掛牌交易並受其約束。² 這些合約按照CBOT規則和條例掛牌交易並受其約束。

股指

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
E-迷你 S&P 500 指數 ¹	ES	372,260	\$32,688	24,96,782	100%	0%
E-迷你納斯達克 100 指數 ¹	NQ	5,564	\$378	40,140	100%	0%
E-迷你道瓊斯指數 (\$5) ²	OYMC/OYMP	674	\$19	16,137	100%	0%

¹ 這些合約按照CME規則和條例掛牌交易並受其約束。² 這些合約按照CBOT規則和條例掛牌交易並受其約束。

能源

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
原油 (WTI)	LO	111,105	\$10,186	3,072,907	46%	↑12%
天然氣	ON, LN	118,025	\$4,486	5,574,914	13%	↑1%
紐約港超低硫柴油	OH	3,197	\$387	119,085	5%	↑2%
RBOB 汽油	OB	1,914	\$183	30,804	16%	↑5%

這些合約按照NYMEX規則和條例掛牌交易並受其約束。

外匯

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
歐元/美元	6E	27,510	\$4,682	284,451	89%	↑10%
日元/美元	6J	11,756	\$1,464	155,041	87%	↑8%
英鎊/美元	6C	9,479	\$958	100,962	88%	↑1%
澳幣/美元	6A	6,957	\$642	98,168	92%	↑7%
加幣/美元	6B	4,875	\$463	64,864	91%	↑1%
瑞郎/美元	6F	756	\$105	12,503	97%	↑8%

這些合約按照CME規則和條例掛牌交易並受其約束。

農產品

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
玉米 ²	OZC	72,434	\$12,619	944,512	51%	↑8%
黃豆 ²	OZS	48,899	\$23,824	479,009	54%	↑17%
小麥 ²	OZW	16,855	\$4,613	264,729	47%	↑9%
活牛 ¹	LE	10,588	\$562	201,447	68%	↑12%
豆粕 ²	OZL	8,982	\$3,054	112,455	44%	↑8%
瘦肉豬 ¹	HE	6,969	\$252	152,837	73%	↑10%
豆油 ²	ZM	4,347	\$106	59,248	20%	↑11%
KCBT硬紅冬小麥 ²	OKE	1,022	\$753	23,954	45%	↑47%

¹ 這些合約按照CME規則和條例掛牌交易並受其約束。² 這些合約按照CBOT規則和條例掛牌交易並受其約束。³ 這些合約按照KCBT規則和條例掛牌交易並受其約束。

金屬

	代碼 (CME GLOBEX)	每日平均成交量 (ADV)	ADV名義金額 (百萬美元)	未平倉量	Q3電子交易%	電子交易同比變化%
黃金	OG	32,043	\$3,993	1,452,102	54%	↑7%
白銀	SO	6,951	\$728	174,424	67%	↑14%
銅	HX	105	\$8	1,840	91%	↑8%

這些合約按照COMEX規則和條例掛牌交易並受其約束。

期權產品頁面

期權新聞、產品信息、教育、特色報告、工具及資源
cmegroup.com/options

QUIKSTRIKE 期權估值工具

- 按行使價劃分的當前和歷史波動性數據
- 成交量和未平倉量資訊
- 價差分析和風險圖形
- Delta表
- 看漲和看跌期權理論值
- 期權和定價分析
- cmegroup.com/quikstrike

季度期權更新

cmegroup.com/optionsupdates

未平倉合約簡介工具

- 農產品: cmegroup.com/agoptionsoi
- 能源: cmegroup.com/energyoi
- 股指: cmegroup.com/eqoptionsoi
- 外匯: cmegroup.com/fxoptionsoi
- 匯率: cmegroup.com/iroptionsoi
- 金屬: cmegroup.com/metalsoi

期權 LINKEDIN 討論組

了解最新相關的期權新聞和討論

linkd.in/ztKFMA

股指期權每日波動曲面報告

cmegroup.com/volsurface

現在立即聯繫您專門的支持團隊。

資產管理公司

assetmanagers@cmegroup.com

銀行

banks@cmegroup.com

企業客戶

commercials@cmegroup.com

對沖基金

hedgefunds@cmegroup.com

自營交易公司

proprietarytrading@cmegroup.com

期貨佣金商/介紹經紀人

intermediaries@cmegroup.com

CME Group是芝加哥商業交易所集團公司的商標。地球標誌、CME、E-迷你及Globex都是芝加哥商品交易所公司的商標。CBOT是芝加哥期貨交易所公司的商標。NYMEX和ClearPort是紐約商業交易所公司的商標。COMEX是紐約商品交易所公司的商標。S&P® 500 指數和S&P 中型股400™指數是The McGraw-Hill Companies公司的商標，並許可為芝加哥商品交易所公司所用。NASDAQ-100 是納斯達克交易所的商標，並許可為芝加哥商品交易所公司所用。Dow Jones是道瓊斯公司的商標，並許可為芝加哥商品交易所公司所用。Nikkei 225™是日本經濟新聞社公司的商標，並許可為芝加哥商品交易所公司所用。所有其他商標都是其所有者的資產。

本手冊所述信息僅由芝商所為一般用途而編寫。對於任何錯誤或遺漏的地方，芝商所概不負責。

本手冊的內容不構成說明書，也非買賣或保留任何投資產品的建議。此手冊專為專業客戶所提供，並非為非專業客戶所使用；非專業客戶應當諮詢獨立的財務建議。此手冊的發行應適當限制。由CME Marketing Europe Limited 發行。CME Marketing Europe Limited 的投資業務行為受英國金融服務管理局授權和監督。

芝商所© 2014 年版權所有，保留所有權利。