

c:jackpsin	vst.ps	22-Nov	21-Nov	20-Nov	19-Nov	18-Nov	15-Nov	14-Nov	13-Nov	12-Nov	11-Nov	8-Nov	7-Nov--
FVH03		11029	11040	11061	11133	11126	11122	11134	11227	11222		11216	11211
1085S													
volatility		11.85	11.62	10.93	10.10	10.42	10.53	10.28	8.95	9.14		9.03	9.56
delta		.58	.59	.60	.63	.62	.62	.62	.67	.66		.66	.65
109S		249	258	301	324	323	321	331	400	401		403	404
volatility		5.75	5.91	5.79	5.97	6.06	5.97	6.10	5.98	6.18		6.35	6.51
delta		.36	.39	.46	.56	.53	.52	.54	.68	.65		.62	.59
1095S		239	246	249	307	306	305	313	342	345		347	349
volatility		5.71	5.83	5.65	5.91	5.97	5.91	5.98	5.89	6.15		6.27	6.43
delta		.25	.28	.36	.47	.44	.42	.45	.61	.58		.55	.52
110S		231	237	237	255	256	255	261	320	325		327	333
volatility		5.62	5.74	5.55	5.77	5.88	5.80	5.85	5.70	6.00		6.09	6.38
delta		.13	.17	.25	.37	.34	.32	.36	.54	.50		.47	.44
1105S		227	230	229	243	246	246	251	304	310		313	319
volatility		5.52	5.59	5.46	5.68	5.82	5.76	5.81	5.67	5.96		6.05	6.31
delta		.00	.04	.13	.26	.23	.21	.25	.45	.41		.38	.35
111S		229	230	227	235	238	240	244	254	262		302	307
volatility		5.49	5.54	5.43	5.60	5.70	5.70	5.76	5.59	5.92		6.01	6.20
delta		-.13	-.09	.00	.14	.11	.09	.14	.35	.31		.28	.26
1115S		235	234	227	231	236	238	238	243	252		256	263
volatility		5.45	5.49	5.33	5.52	5.66	5.64	5.62	5.51	5.83		5.89	6.13
delta		-.26	-.21	-.13	.02	-.01	-.03	.02	.23	.21		.18	.16
112S		247	244	235	231	238	242	240	237	246		252	260
volatility		5.50	5.51	5.37	5.44	5.62	5.66	5.61	5.47	5.76		5.87	6.11
delta		-.38	-.33	-.26	-.11	-.14	-.15	-.10	.12	.09		.07	.05
1125S		262	256	245	237	245	248	246	235	246		252	261
volatility		5.52	5.46	5.33	5.43	5.63	5.61	5.62	5.44	5.77		5.86	6.11
delta		-.48	-.45	-.38	-.24	-.25	-.27	-.22	-.01	-.02		-.04	-.06
113S		315	309	261	249	255	259	256	239	248		256	301
volatility		5.49	5.48	5.40	5.50	5.60	5.62	5.63	5.47	5.73		5.85	6.10
delta		-.58	-.55	-.49	-.35	-.37	-.38	-.33	-.13	-.14		-.16	-.16
1135S													
volatility		2.77	2.76	2.69	4.38	4.48	4.48	4.66	4.77	5.01		5.58	5.82
delta		-.83	-.82	-.79	-.58	-.60	-.60	-.53	-.29	-.30		-.29	-.29
114S													
volatility		2.81	2.76	2.67	2.72	2.83	2.82	2.82	3.49	3.87		4.10	4.38
delta		-.87	-.86	-.84	-.78	-.78	-.79	-.77	-.63	-.59		-.57	-.55
1145S													
volatility		2.84	2.82	2.70	2.72	2.83	2.82	2.80	2.70	2.87		2.95	3.07
delta		-.90	-.89	-.87	-.83	-.83	-.83	-.81	-.74	-.73		-.73	-.73
115S													
volatility		2.83	2.82	2.72	2.70	2.87	2.86	2.80	2.72	2.89		2.98	3.06
delta		-.92	-.91	-.90	-.87	-.86	-.86	-.85	-.78	-.78		-.77	-.77

FVM03 - no futures

=====