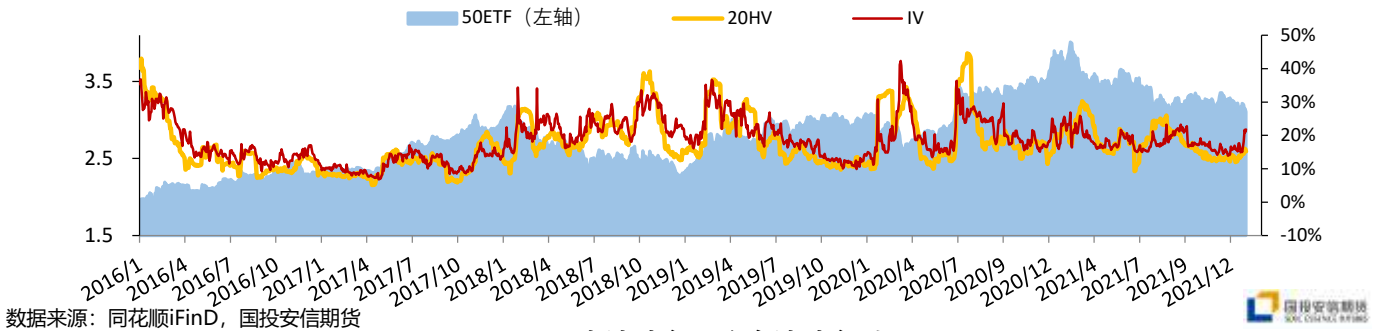


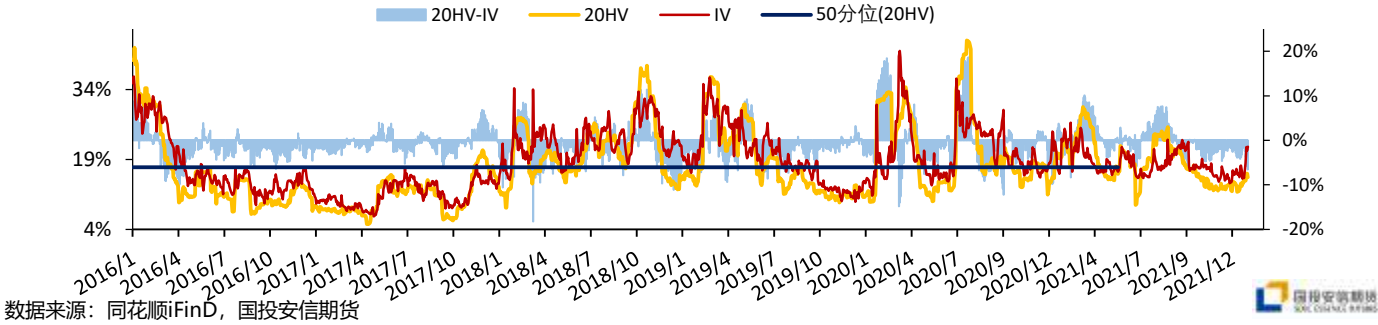
【50ETF】 距合约到期14天, 距合约换月11天 (交易日)

日期	标的物价格	20HV	40HV	60HV	当月同期HV	当月IV	近1年IV分位数	近2年IV分位数	次月IV / 同期HV
2022/1/25	3.129	15.99%	14.37%	13.94%	15.91%	21.69%	86.50%	75.00%	0.00% 15.08%
2022/1/26	3.144	15.94%	14.36%	13.80%	16.72%	20.90%	81.20%	70.50%	0.00% 15.14%
2022/1/27	3.107	15.21%	14.61%	13.87%	16.75%	21.75%	88.50%	75.80%	0.00% 14.15%

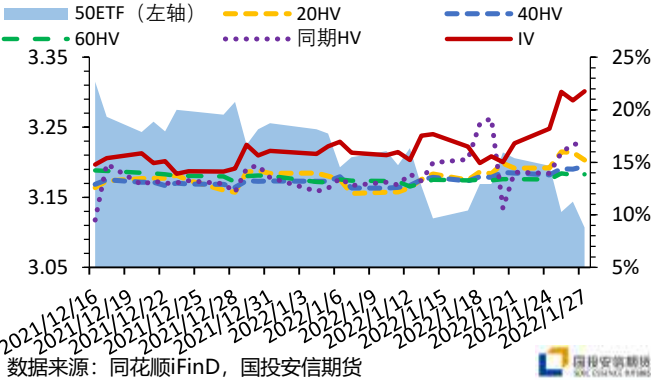
50ETF价格、波动率对比



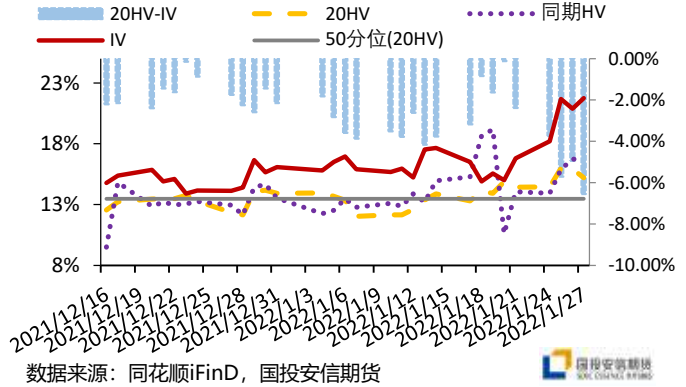
50ETF历史波动率、隐含波动率对比



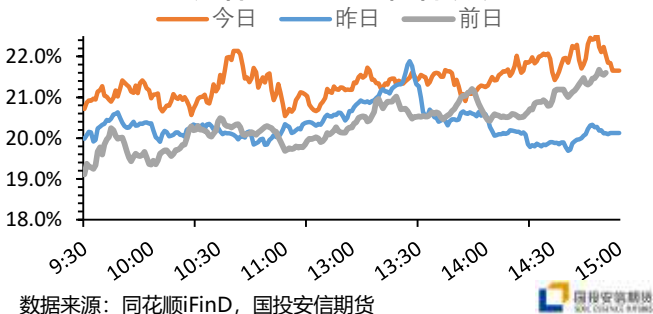
最近30日50ETF价格、波动率对比



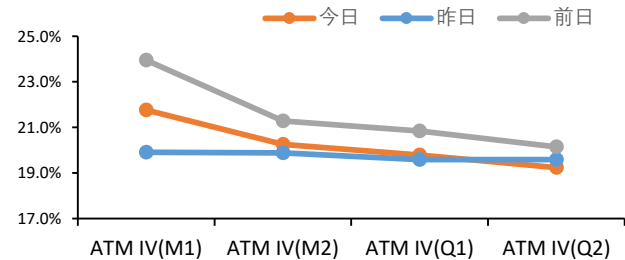
最近30日50ETF历史波动率、隐含波动率对比



当月合约日内ATM隐含波动率

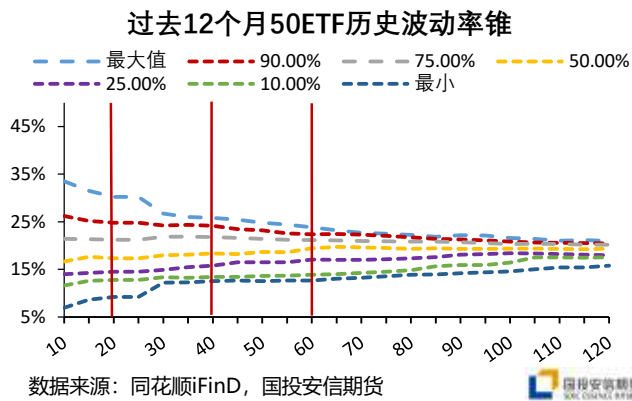
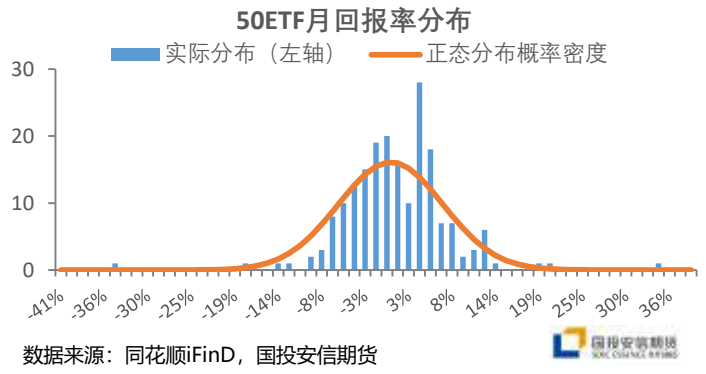
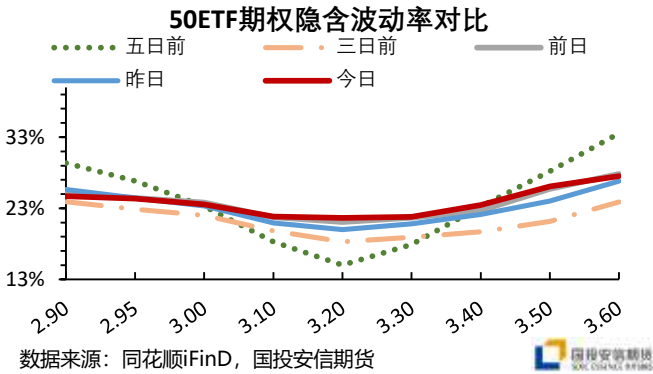


ATM IV期限结构

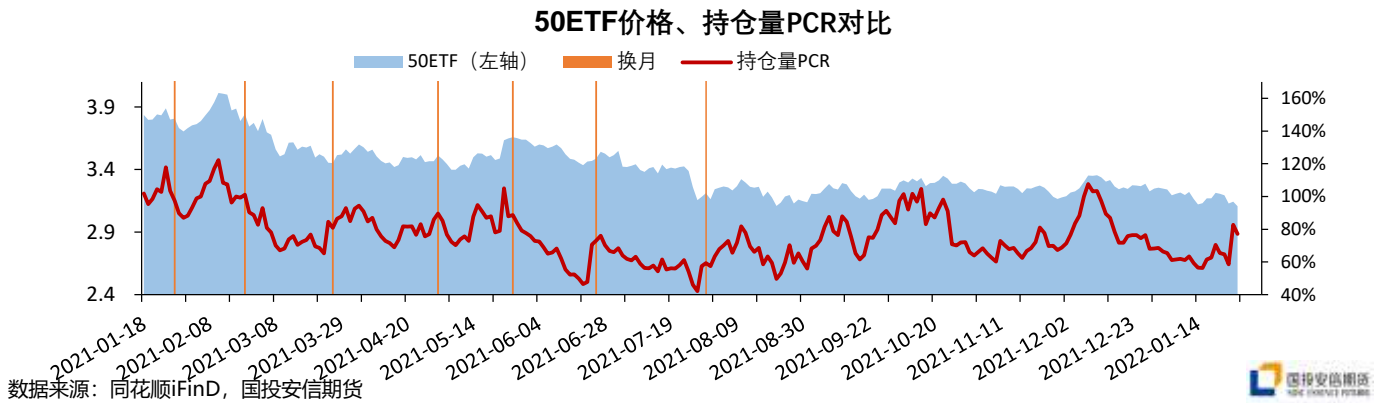


日内振幅	今日	昨日	前日
	2.04%	2.20%	2.57%

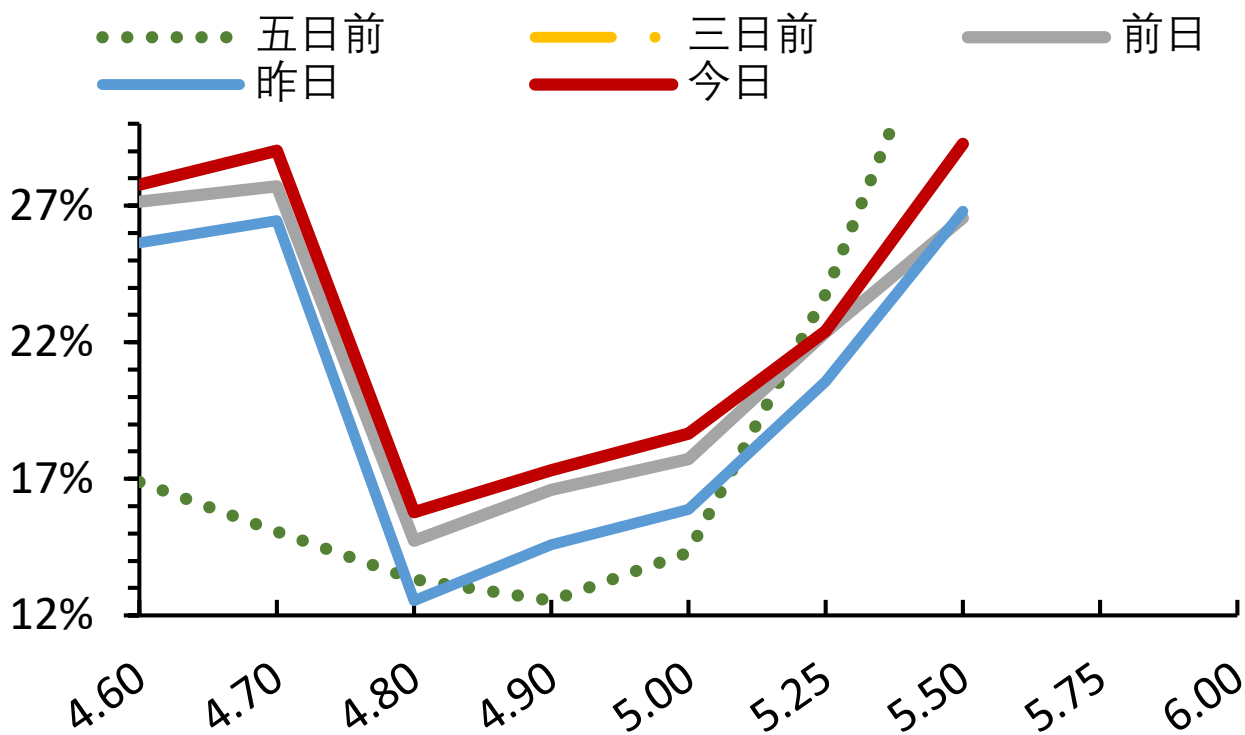
skew指数:	今日	昨日	前日	三日前	四日前	五日前
	100.82	102.92	100.87	102.16	79.49	71.19



历史波动率	20日HV	40日HV	60日HV
90分位	24.81%	24.14%	22.38%
50分位	17.35%	18.35%	19.45%
10分位	12.76%	13.40%	13.86%



沪300ETF期权隐含波动率对比



数据来源：同花顺iFinD，国投安信期货

