

摘要:

作者: 金融衍生品组 彭博

执业编号: F0305572 (从业) Z0011662 (投资咨询)

联系方式: 010-68578611/ pengbo1@foundersc.com

投资咨询业务资格: 京证监许可【2012】75号

成文时间: 2022年12月1日星期四

【行情复盘】

12月1日, 沪深300指数涨1.08%, 报3894.77; 上证50指数涨0.95%, 报2631.21; 中证1000指数涨1.03%, 报6658.43。

【重要资讯】

广州多区解除临时管控区, 通告符合居家隔离条件的密切接触者实施居家隔离, 因疫情防控停止运营的地铁站和海珠有轨电车逐步恢复正常运营服务。

美联储贴现利率会议纪要: 9家地方联储支持在11月将贴现利率提高75BP, 3家支持50BP。

北向资金今日大幅净买入114.5亿元。

12月1日, 人民币对美元即期汇率16时30分收盘报7.0791, 较上一交易日日间收盘上涨628个基点, 较前一交易日夜盘收盘上涨138个基点。

【推荐策略】

300ETF 期权: 卖出12月认购期权4.5。

股指期权: 卖出12月4500认购期权。

上证50ETF 期权: 卖出12月3.1认购期权。

中证1000 股指期权: 卖出12月7500认购期权。

创业板ETF 期权: 卖出12月2.4认购期权。

中证500ETF 期权: 卖出12月6.5认购期权。



更多精彩内容请关注方正中期官方微信

请务必阅读最后重要事项

目录

一、指数行情走势	3
二、期权成交及持仓分析	4
1、50ETF 成交情况	4
2、300ETF 成交情况	5
3、500ETF 成交情况	5
4、创业板 ETF 成交情况	6
5、沪深 300 股指期权成交情况	6
6、中证 1000 股指期权成交情况	7
三、波动率分析	7
1、50ETF 期权波动率	7
2、300ETF 期权波动率	8
3、500ETF 期权波动率	9
4、创业板 ETF 期权波动率	10
5、沪深 300 股指期权波动率	11
6、中证 1000 股指期权波动率	12

一、指数行情走势

图： 沪深 300 指数走势图



图： 上证 50 指数价格走势图

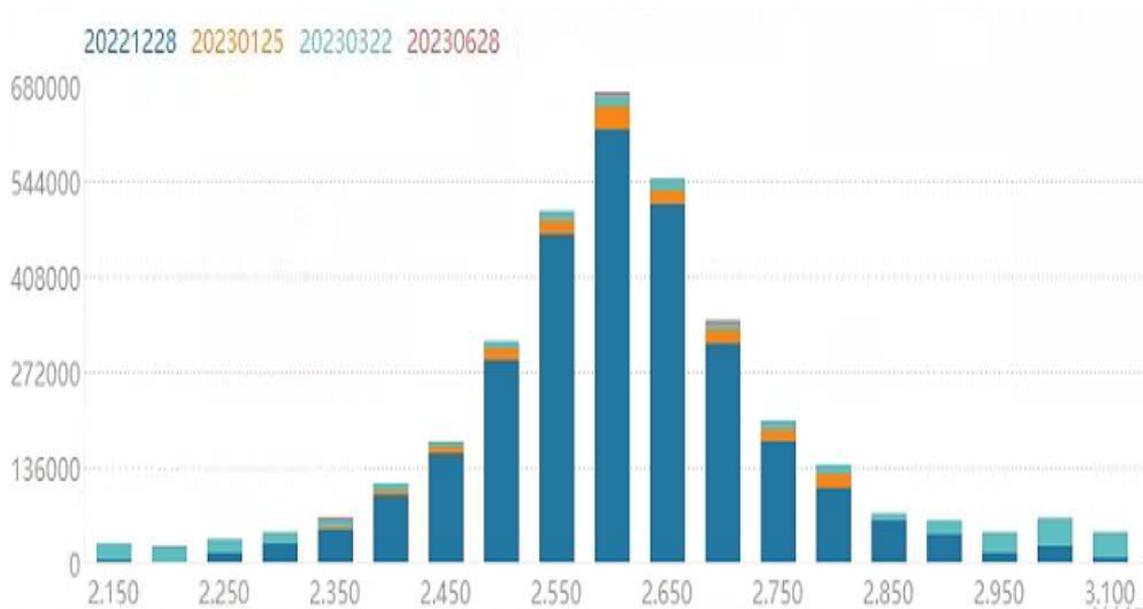


图： 中证 1000 指数价格走势图

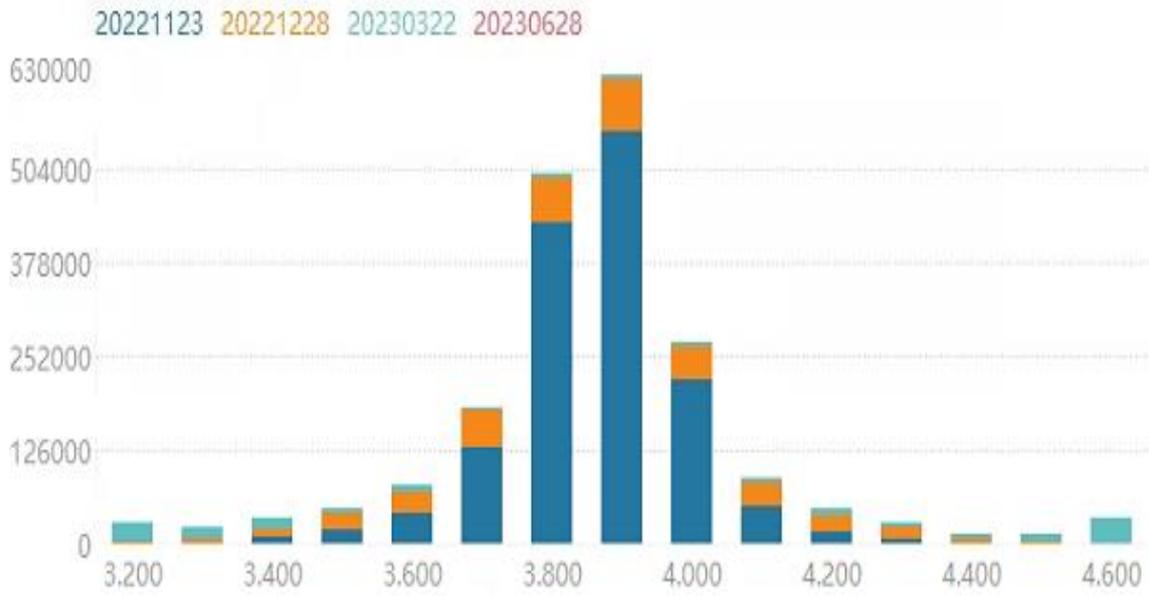


二、期权成交及持仓分析

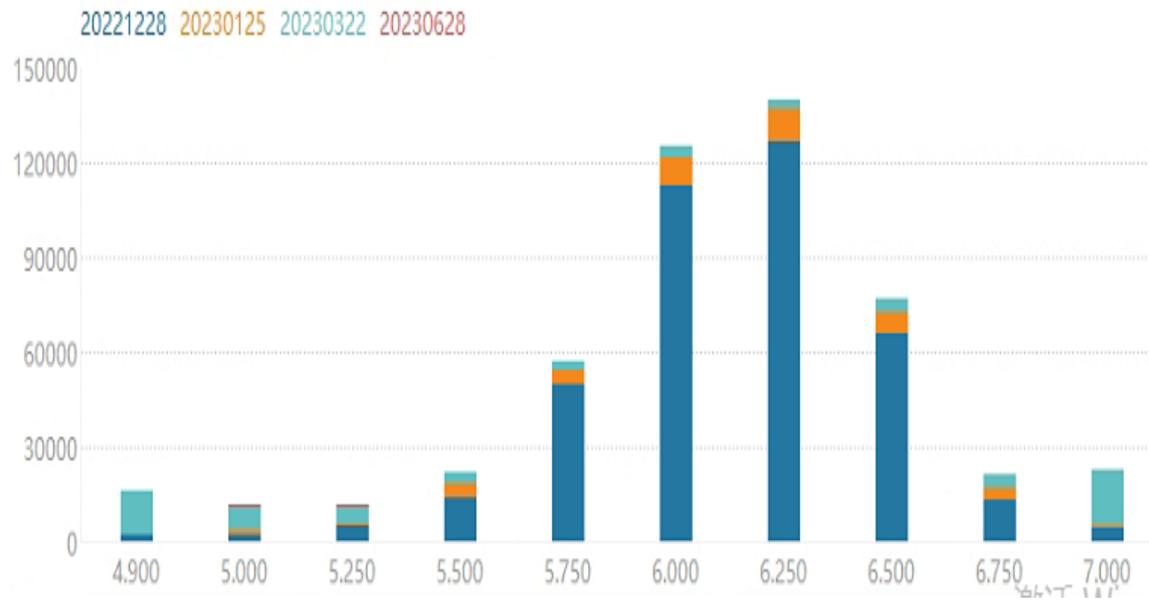
1、50ETF 成交情况



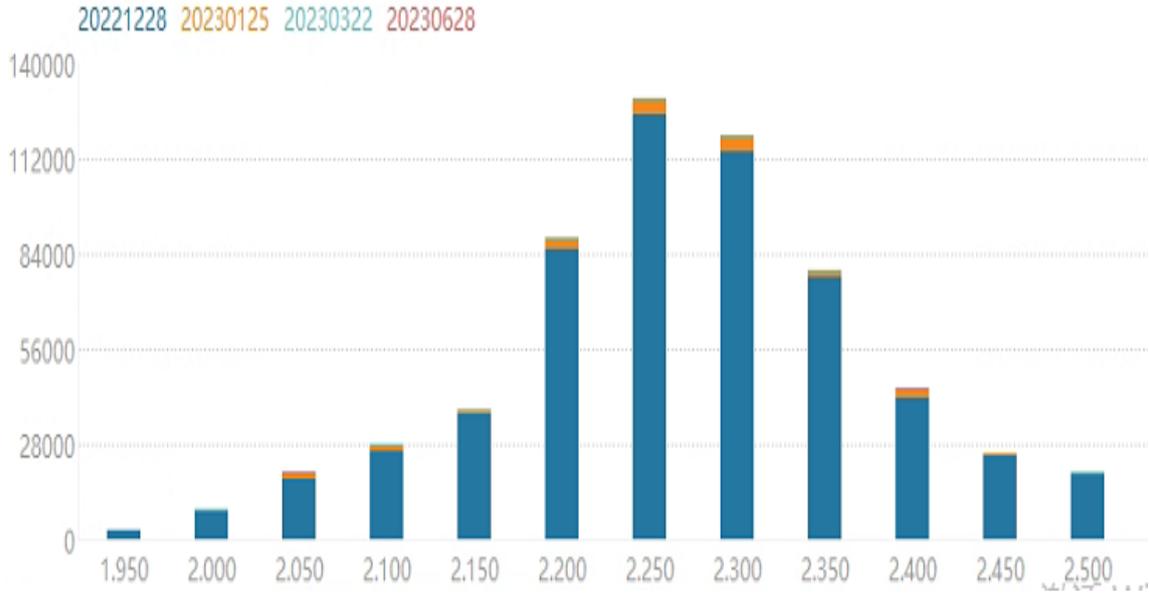
2、300ETF 成交情况



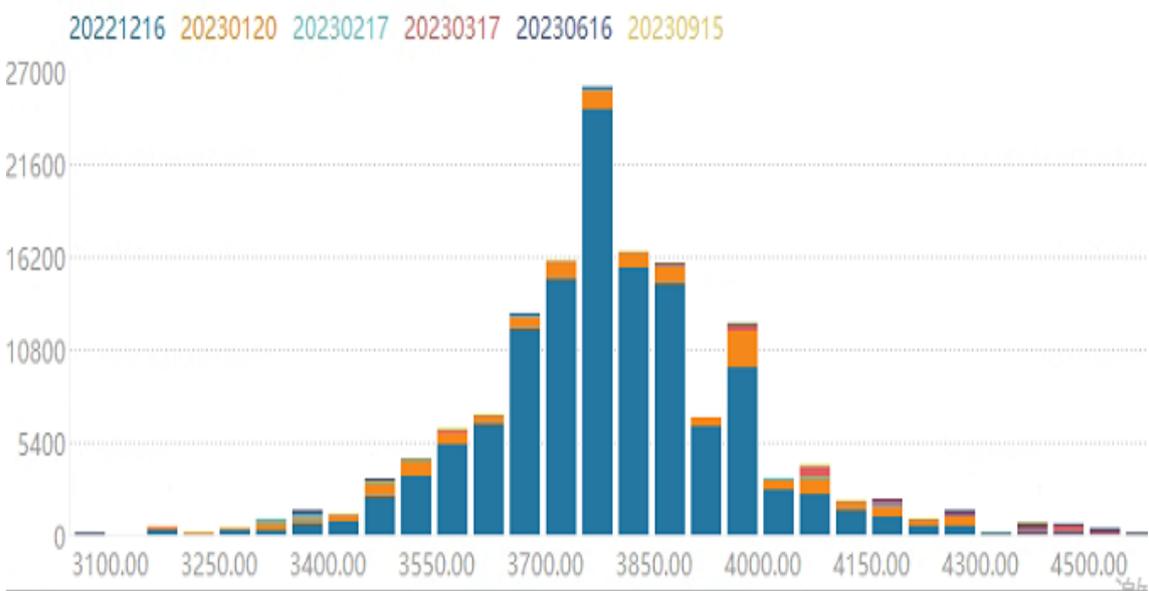
3、500ETF 成交情况



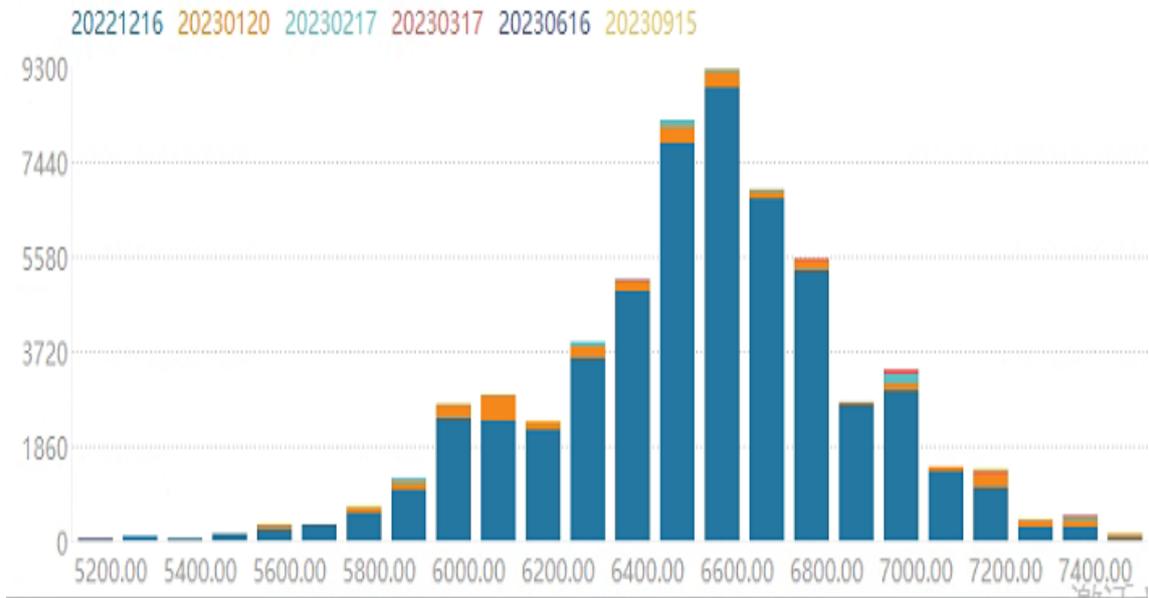
4、创业板 ETF 成交情况



5、沪深 300 股指期权成交情况



6、中证 1000 股指期权成交情况

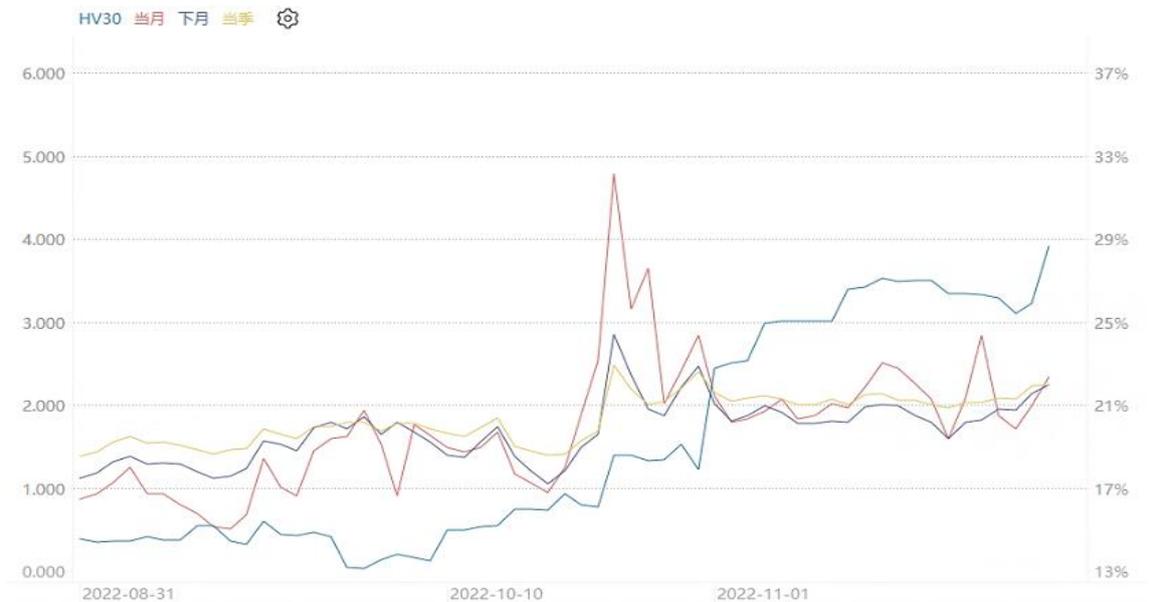


资料来源: Wind, 方正中期期货

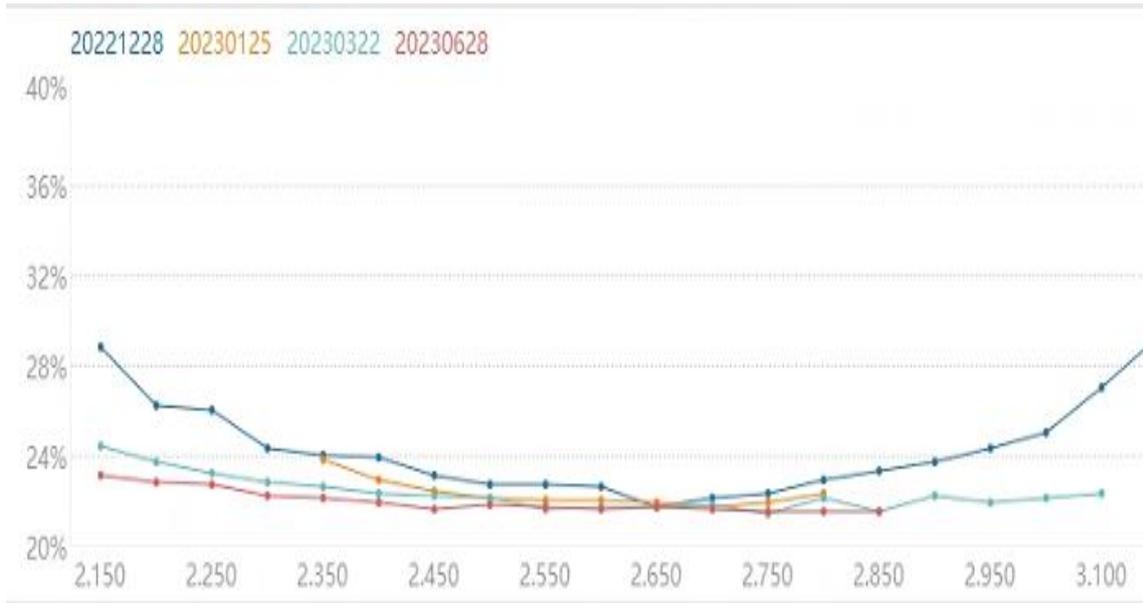
三、波动率分析

1、50ETF 期权波动率

图：50ETF 期权波动率数据



图：50ETF 期权近月合约隐含波动率微笑曲线



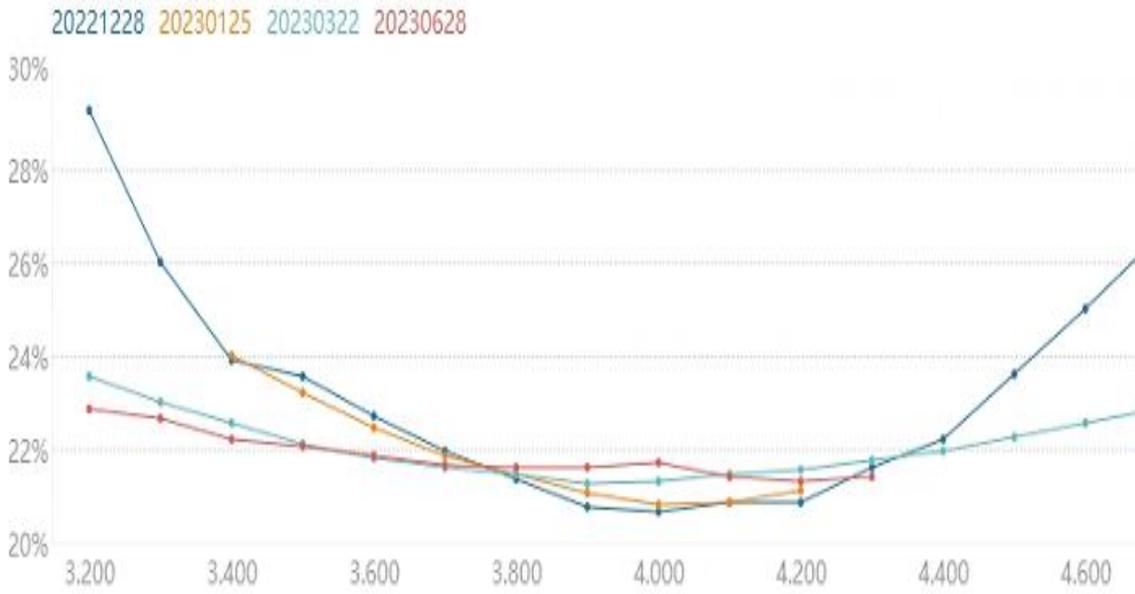
资料来源: Wind, 方正中期期货

2、300ETF 期权波动率

图：300ETF (510300) 近月合约隐含波动率微笑曲线



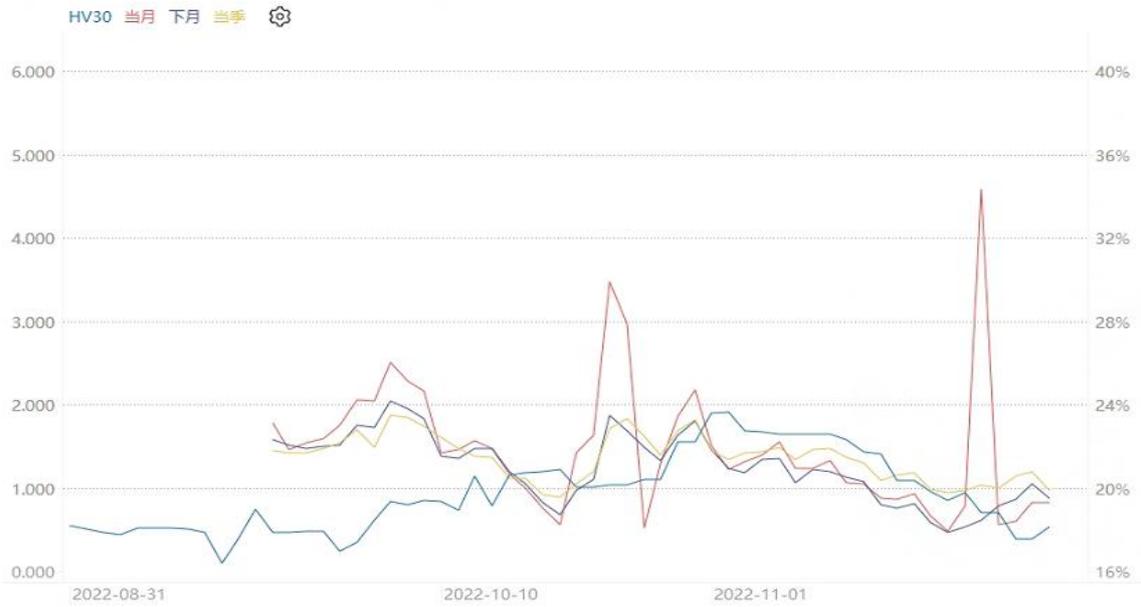
图：300ETF 期权合约隐含波动率微笑曲线



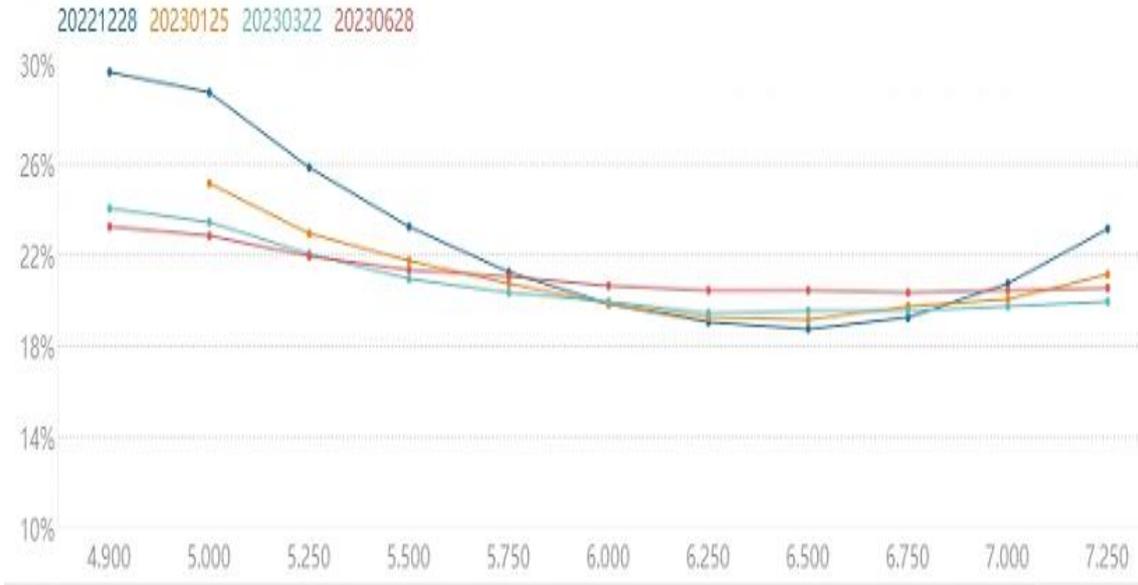
资料来源: Wind, 方正中期期货

3、500ETF 期权波动率

图：500ETF 期权隐含波动率指数



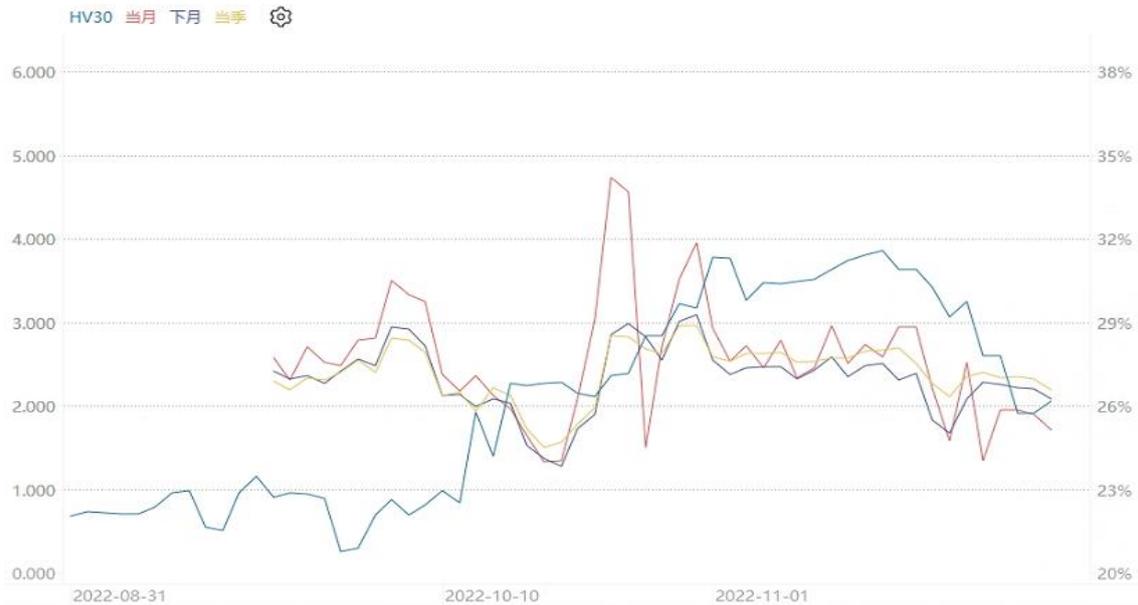
图：500ETF 期权合约隐含波动率微笑曲线



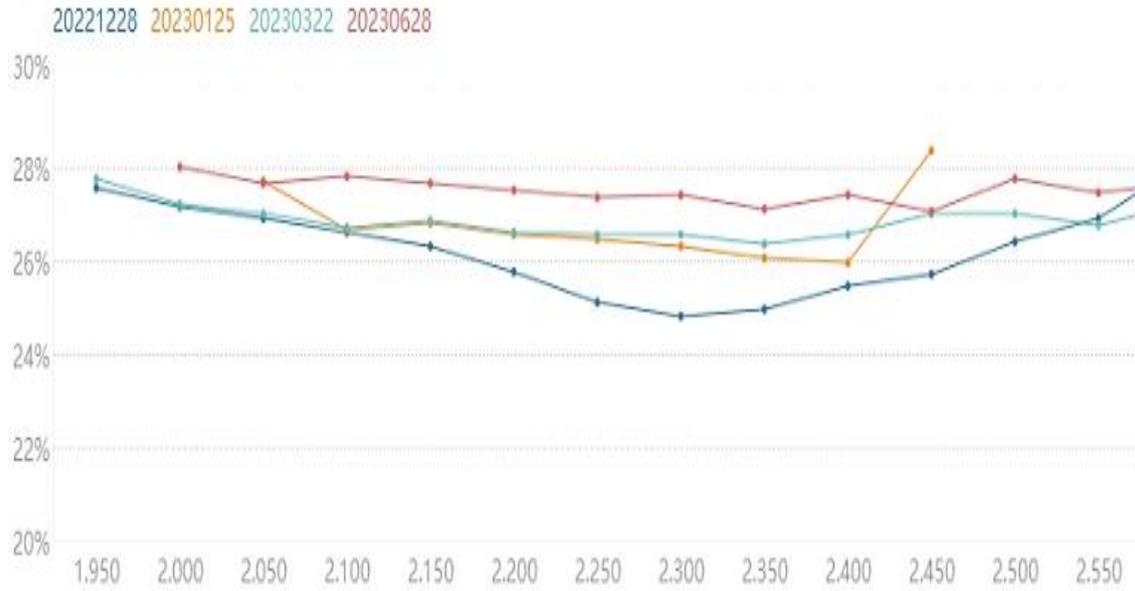
资料来源: Wind, 方正中期期货

4、创业板 ETF 期权波动率

图：创业板 ETF 期权隐含波动率指数



图：创业板 ETF 期权合约隐含波动率微笑曲线



资料来源: Wind, 方正中期期货

5、沪深 300 股指期权波动率

图：沪深 300 股指期权隐含波动率指数



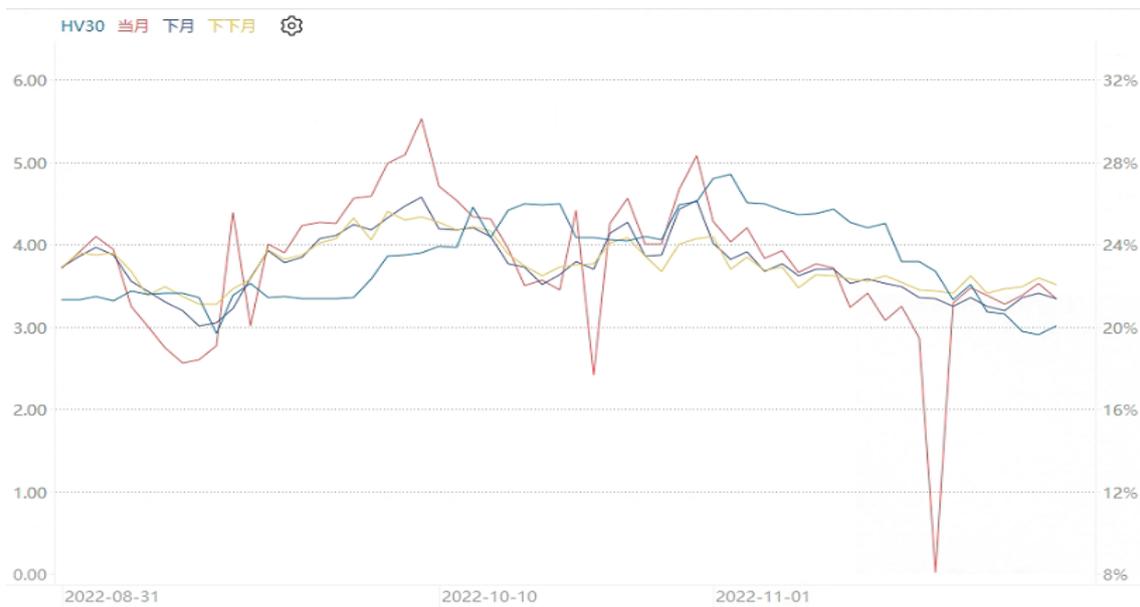
图：股指期权近月合约隐含波动率微笑曲线



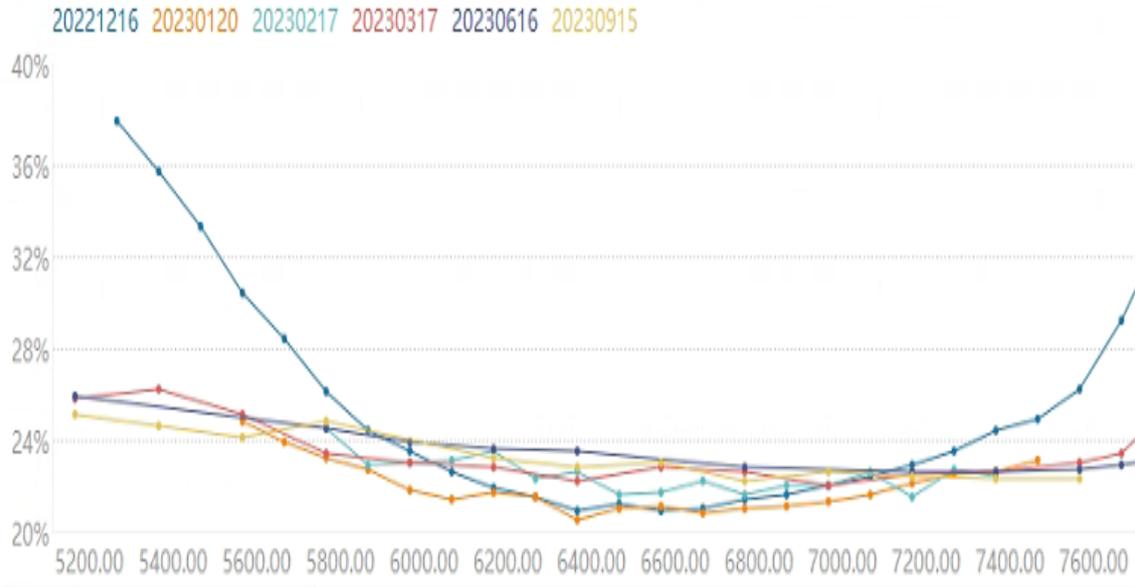
资料来源: Wind, 方正中期期货

6、中证 1000 股指期权波动率

图：中证 1000 股指期权隐含波动率指数



图：股指期权近月合约隐含波动率微笑曲线



资料来源: Wind, 方正中期期货

联系我们:

分支机构	地址	联系电话
总部业务平台		
资产管理部	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881312
期货研究院	北京市西城区展览馆路48号新联写字楼4层	010-85881117
投资咨询部	北京市西城区展览馆路48号新联写字楼4层	010-68578587
产业发展部	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881109
金融产品部	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881295
金融机构部	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881228
总部业务部	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881292
分支机构信息		
北京分公司	北京市西城区展览馆路48号新联写字楼4层	010-68578987
北京石景山分公司	北京市石景山区金府路32号院3号楼5层510室	010-66058401
北京朝阳分公司	北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦22层	010-85881205
河北分公司	河北省唐山市路北金融中心A座2109、2110室	0315-5396886
保定分公司	河北省保定市高新区朝阳北大街2238号汇博上谷大观B座1902、1903室	0312-3012016
南京分公司	江苏省南京市栖霞区紫东路1号紫东国际创业园西区E2-444	025-58061185
苏州分公司	江苏省苏州市工业园区通园路699号苏州港华大厦1606室	0512-65162576
上海分公司	上海市浦东新区长柳路58号证大立方大厦604室	021-50588107/ 021-50588179
常州分公司	江苏省常州市钟楼区延陵西路99号嘉业国贸广场32楼	0519-86811201
湖北分公司	湖北省武汉市硚口区武胜路花祥年喜年中心18层1807室	027-87267756
湖南第一分公司	湖南省长沙市雨花区芙蓉中路三段569号陆都小区湖南商会大厦东塔26层2618-2623室	0731-84310906
湖南第二分公司	湖南省长沙市岳麓区滨江路53号楷林商务中心C座2304、2305、2306	0731-84118337
湖南第三分公司	湖南省长沙市芙蓉区黄兴中路168号新大新大厦5层	0731-85868397
深圳分公司	广东省深圳市福田区中康路128号卓越城一期2号楼806B室	0755-82521068
广东分公司	广东省广州市天河区林和西路3-15号耀中广场B座35层07-09室	020-38783861
上海自贸试验区分公司	上海市浦东新区南泉北路429号1703	021-58991278
北京望京营业部	北京市朝阳区望京中环南路望京大厦B座12层8-9号	010-62681567
天津营业部	天津市和平区大沽北路2号津塔写字楼2908室	022-23559950
天津滨海新区营业部	天津市滨海新区第一大街79号泰达MSD-C3座1506单元	022-65634672
包头营业部	内蒙古自治区包头市青山区钢铁大街7号正翔国际S1-B8座1107	0472-5210710
邯郸营业部	河北省邯郸市丛台区人民路与滏东大街交叉口东南角环球中心T6塔楼13层1305房间	0310-3053688
青岛营业部	山东省青岛市崂山区香港东路195号上实中心T6号楼10层1002室	0532-82020088
太原营业部	山西省太原市小店区长治路329号和融公寓2幢1单元5层	0351-7889677
西安营业部	陕西省西安市高新区太白南路118号4幢1单元1F101室	029-81870836
上海南洋泾路营业部	上海市浦东新区南洋泾路555号1105、1106室	021-58381123
上海世纪大道营业部	上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦1107室	021-58861093
宁波营业部	浙江省宁波市江北区人民路132号银亿外滩大厦1706室	0574-87096833
杭州营业部	浙江省杭州市江干区采荷嘉业大厦5幢1010室	0571-86690056
南京洪武路营业部	江苏省南京市秦淮区洪武路359号福鑫大厦1803、1804室	025-58065958
苏州东吴北路营业部	江苏省苏州市姑苏区东吴北路299号吴中大厦9层902B、903室	0512-65161340
扬州营业部	江苏省扬州市新城河路520号水利大厦附楼	0514-82990208
南昌营业部	江西省南昌市红谷滩新区九龙大道1177号绿地国际博览城4号楼1419、1420	0791-83881026
岳阳营业部	湖南省岳阳市岳阳楼区建湘路天伦国际11栋102号	0730-8831578
株洲营业部	湖南省株洲市芦淞区新华西路999号中央商业广场(王府井A座11楼)	0731-28102713
郴州营业部	湖南省郴州市苏仙区白鹿洞街道青年大道阳光瑞城1栋10楼	0735-2859888
常德营业部	湖南省常德市武陵区穿紫河街道西园社区滨湖路666号时代广场21楼	0736-7318188
风险管理子公司		
上海际丰投资管理有限责任公司	上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦24楼	021-20778922

重要事项:

本报告中的信息均源于公开资料，方正中期期货研究院对信息的准确性及完备性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，报告中的信息和意见并不构成所述期货合约的买卖出价和征价，投资者据此作出的任何投资决策与本公司和作者无关，方正中期期货有限公司不承担因根据本报告操作而导致的损失，敬请投资者注意可能存在的交易风险。本报告版权仅为方正中期期货研究院所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制发布，如引用、转载、刊发，须注明出处为方正中期期货有限公司。