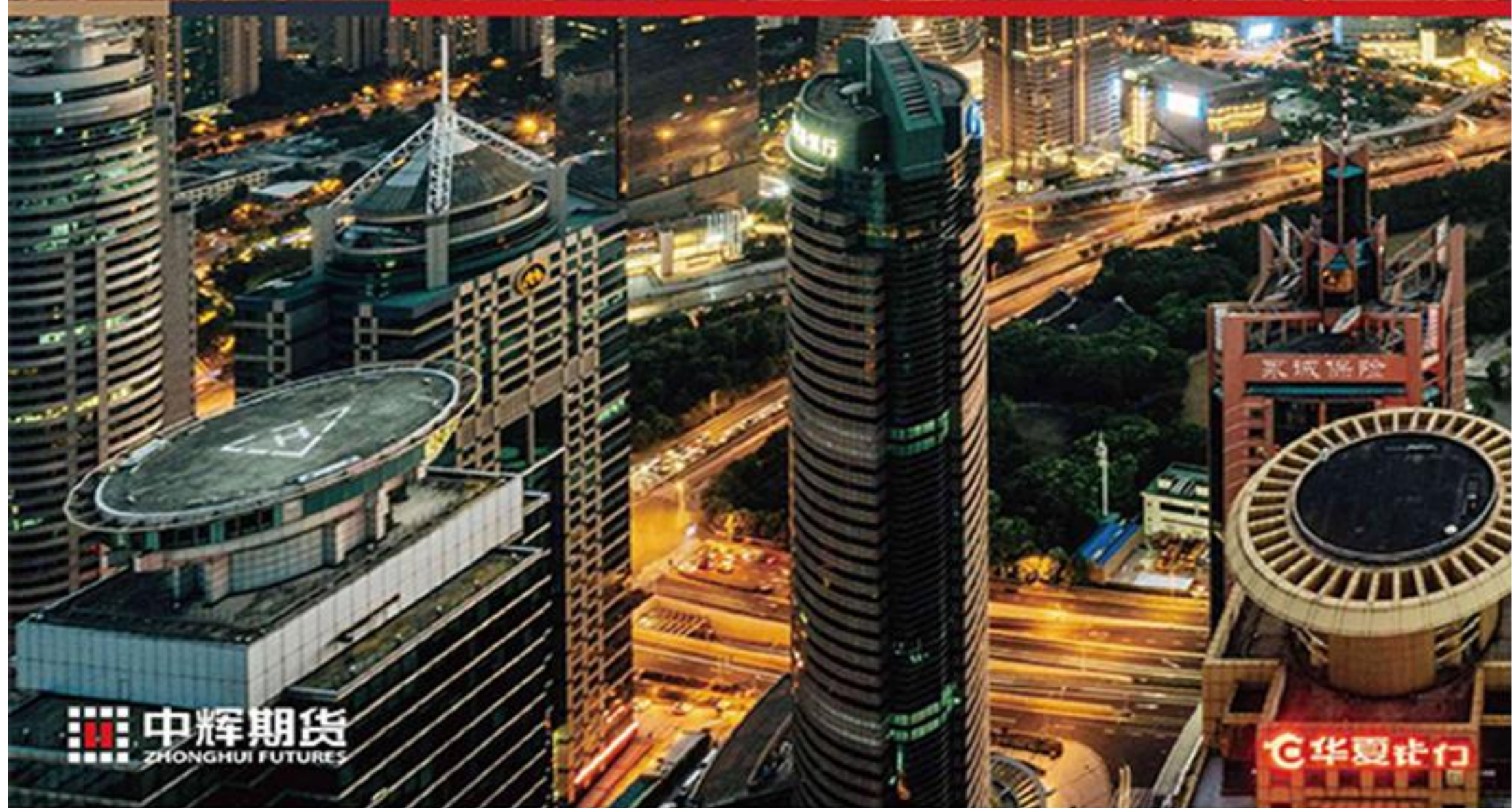




# 期权日度数据报告

— 2023.08.04



 中辉期货  
ZHONGHUI FUTURES

华夏银行

## 指数期权 (3)

### 1. 标的情况

	标的收盘价	涨跌	成交量变化/亿	成交额变化/亿	5日趋势
上证50	2620.68	-25.21	-2.06	-114.54	
沪深300	3969.90	-28.11	-16.43	-507.45	
中证1000	6499.54	3.52	-5.17	-62.81	

### 2. 期权市场情况

	主力合约	剩余交易日	成交量PCR	变化	成交额PCR	变化
上证50	H02308	11	0.60	0.16	0.56	0.21
沪深300	I02308	11	0.49	-0.03	0.47	0.03
中证1000	M02308	12	0.55	0.08	0.66	0.15

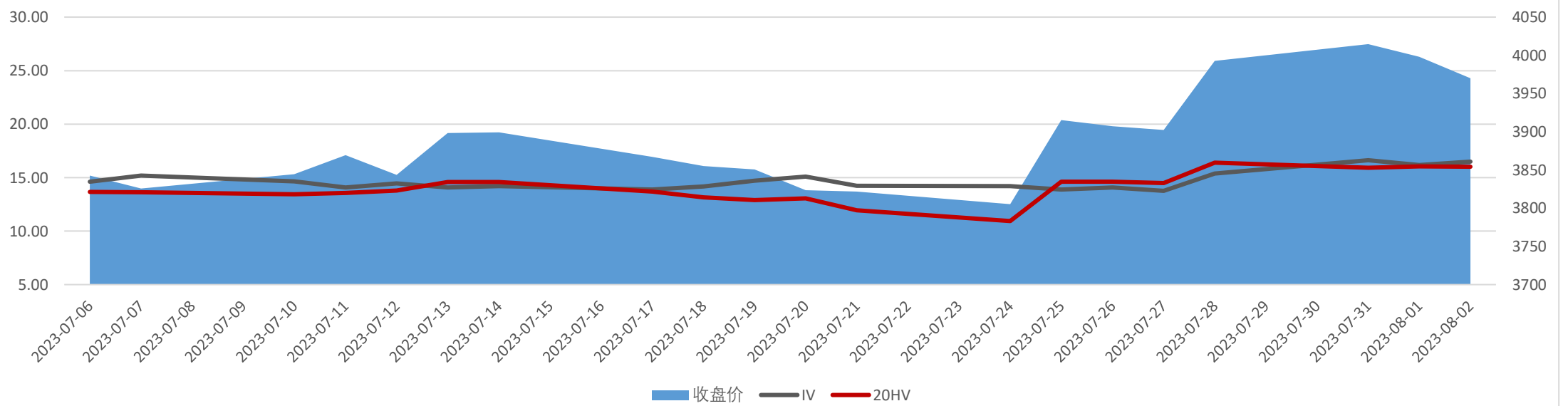
### 3. 期权量化指标

	合成指数	升贴水	IV	20HV	IV-20HV	50分位	IV-20HV变化
上证50	2678.21	57.53	17.36	12.26	5.10	18.86	
沪深300	4009.91	40.01	16.48	16.01	0.48	16.76	
中证1000	6496.80	-2.75	15.22	12.26	2.96	18.86	

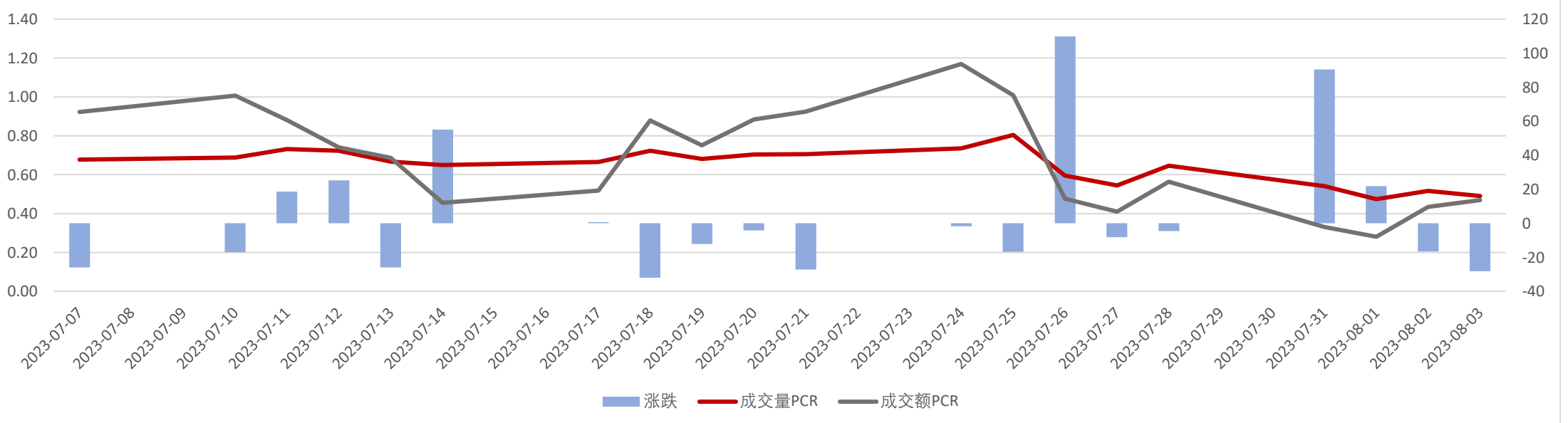
说明: 升贴水=合成-标的; 5日趋势高点红色, 低点绿色; IV-20HV变化高点红色, 负点绿色, 剩余日统指剩余交易日, 下同;

### 4. 数据图表

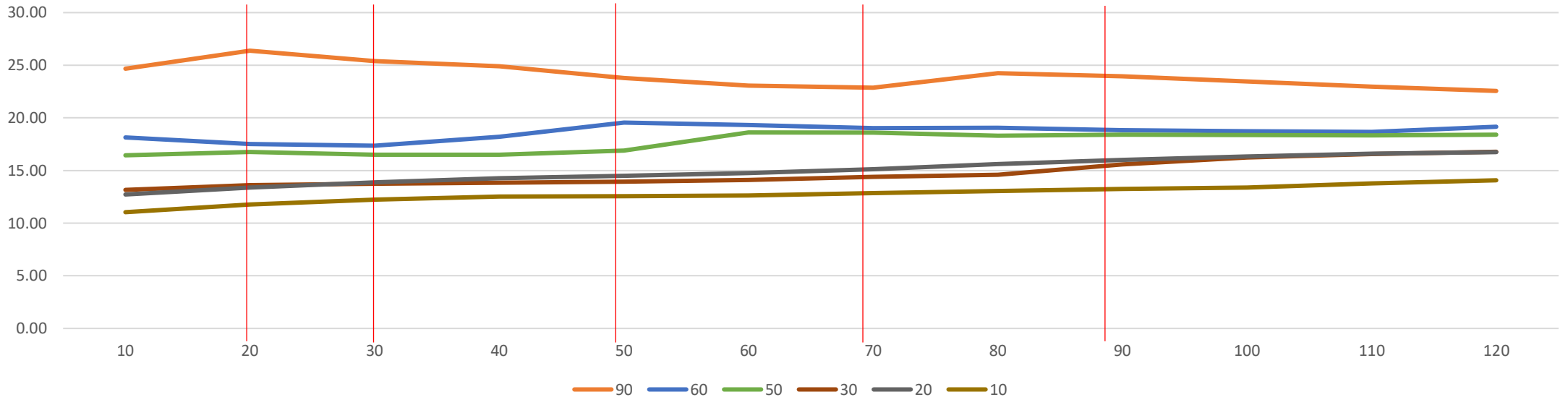
沪深300指数价格、IV、20HV趋势



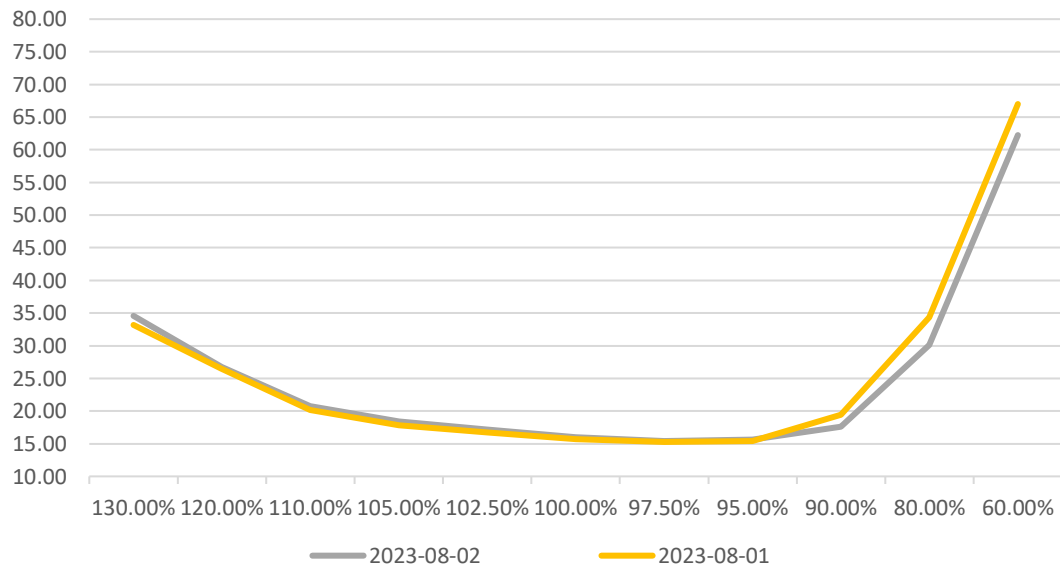
沪深300指数期权PCR



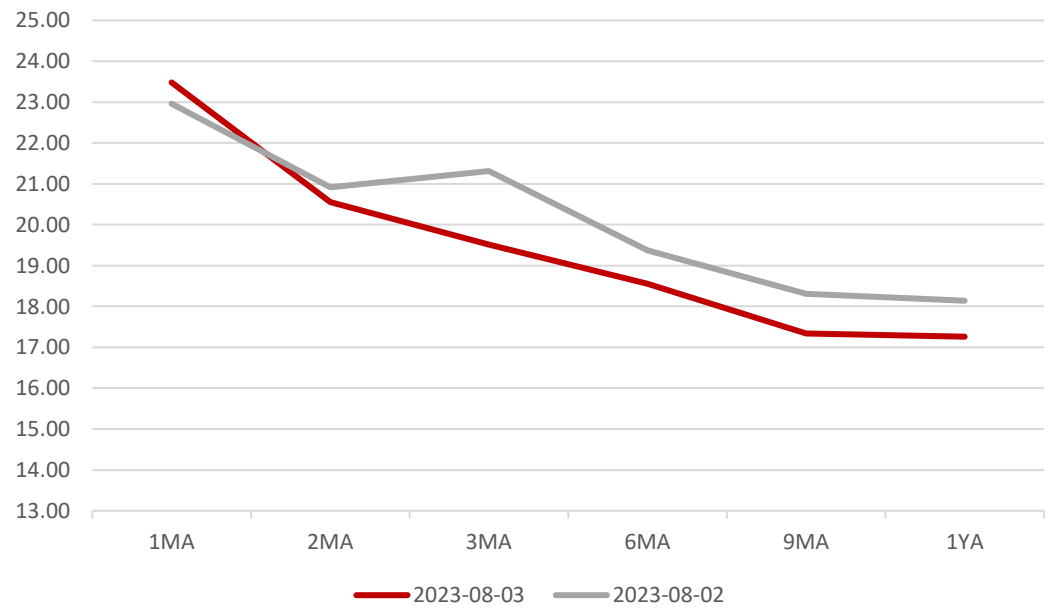
沪深300指数期权历史波动率锥Volatility Cone



沪深300指数波动率偏度  
Volatility Skew



沪深300指数期权期限结构  
Maturity Structure



农产品 (10)

1. 标的情况

	标的收盘价	涨跌	成交量变化/万	持仓量变化/万	5日趋势
豆粕	4322	54	111.64	-6.9944	
菜粕	3671	13	73.93	-1.9801	
豆油	8032	-122	78.96	-2.7923	
菜油	8032	-122	78.96	-2.7923	
棕榈油	7664	176	68.40	-2.2408	
豆一	4929	-33	12.02	0.8369	
豆二	4843	98	10.37	0.6902	
花生	10580	-54	0.88	-0.1163	
玉米	2716	6	29.48	-1.6237	
白糖	6774	31	17.55	-2.0872	
棉花	6774	31	17.55	-2.0872	

2. 期权市场情况

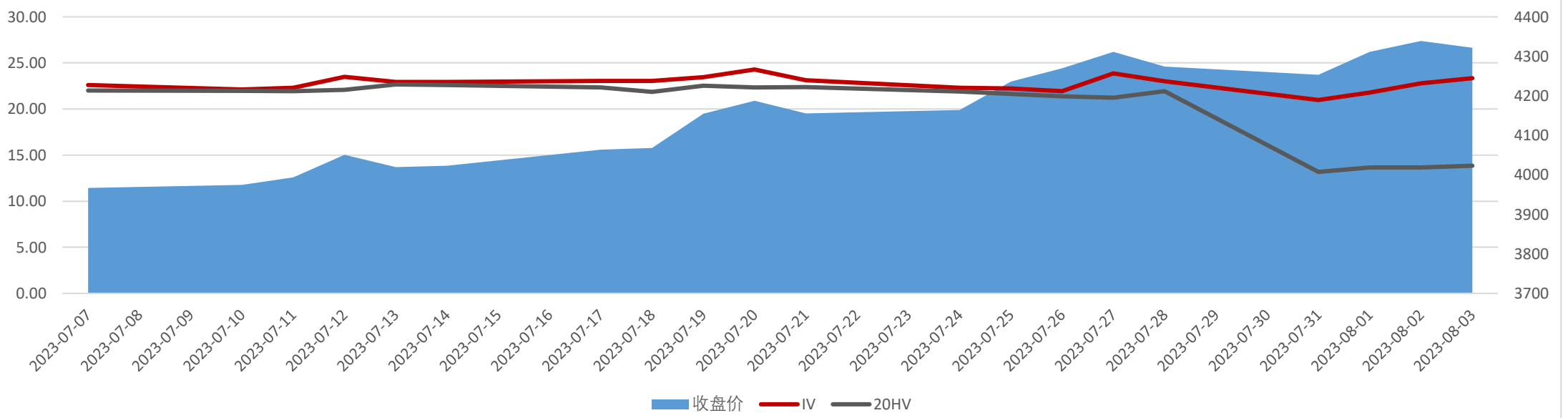
	主力合约	剩余日	持仓量PCR	变化	成交额PCR	变化
豆粕	M2309.DCE	3	1.39	0.39	1.38	0.73
菜粕	RM309.CZC	1	1.34	0.27	1.11	0.24
豆油	Y2309.DCE	2	0.80	0.14	0.93	0.35
菜油	O1309.CZC	1	1.32	0.47	1.77	0.50
棕榈油	P2309.DCE	3	0.73	0.15	0.69	-0.01
豆一	A2309.DCE	2	0.32	-0.15	0.64	0.10
豆二	B2309.DCE	3	0.84	-0.05	0.64	-0.15
花生	PK310.CZC	23	0.72	0.05	1.05	0.40
玉米	C2309.DCE	3	0.79	-0.05	1.06	0.20
白糖	SR309.CZC	88	1.59	-0.45	0.79	-0.90
棉花	SR309.CZC	1	1.59	-0.45	0.79	-0.90

### 3. 期权量化指标

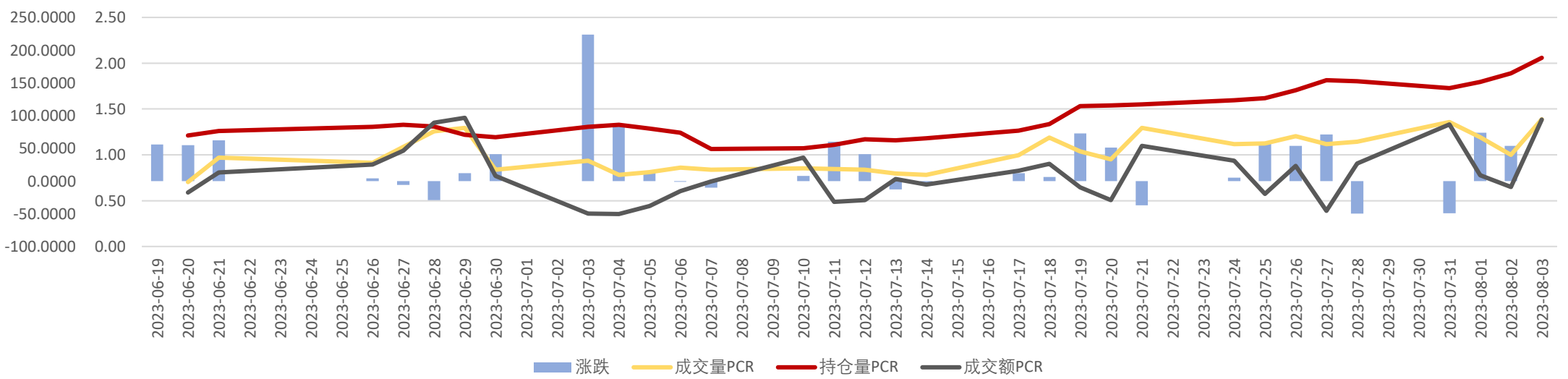
	IV	20HV	IV-20HV	50分位	IV-20HV变化
豆粕	23.34	13.84	9.51	20.64	
菜粕	32.71	22.27	10.43	26.02	
豆油	25.25	13.68	11.57	20.67	
菜油	22.35	13.68	8.67	20.67	
棕榈油	25.90	23.62	2.28	32.68	
豆一	18.87	7.87	11.00	15.87	
豆二	20.10	15.95	4.15	23.19	
花生	18.63	11.29	7.33	19.48	
玉米	12.29	11.06	1.23	12.19	
白糖	13.74	10.62	3.12	12.38	
棉花	13.74	13.84	-0.10	20.64	

### 4. 数据图表

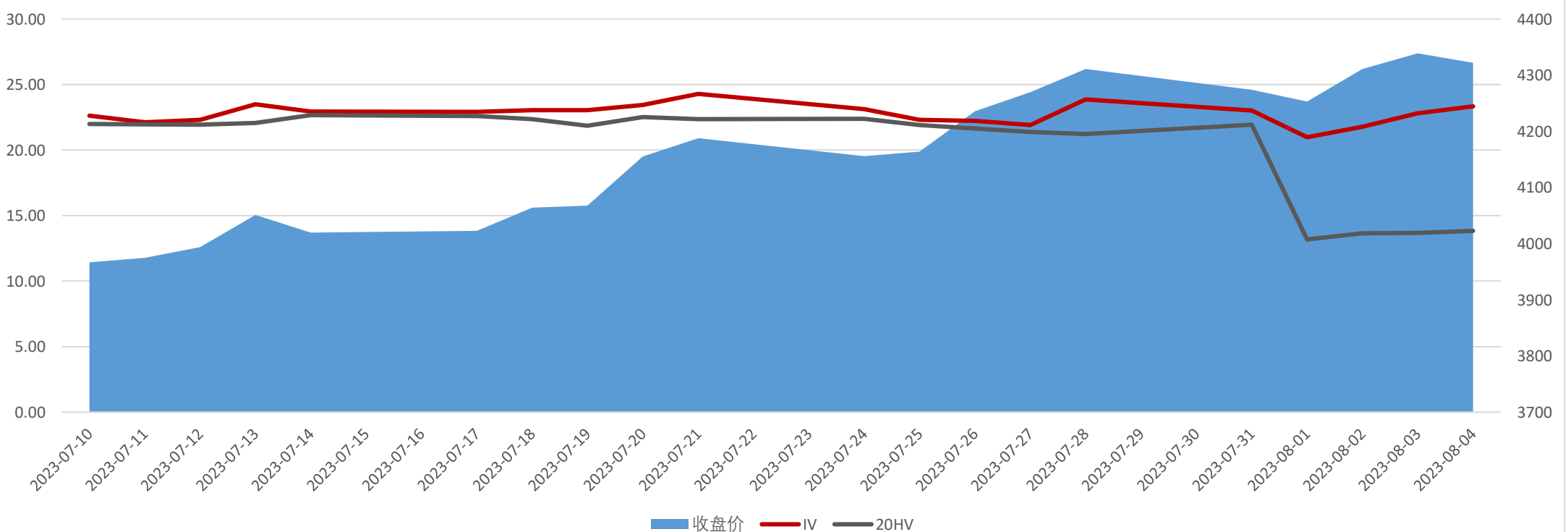
豆粕期权标的的价格&IV、20HV趋势



豆粕主力合约期权PCR



棕榈油期权标的的价格&IV、20HV趋势



## 能源化工 (7)

### 1. 标的情况

	标的收盘价	涨跌	成交量变化/万	持仓量变化/万	5日趋势
原油	625	7.6	14.99	-0.1299	
甲醇	2322	-46	165.62	-14.2385	
PTA	5966	-64	144.13	-9.4265	
聚丙烯	625	7.6	111.64	-6.9944	
PVC	6145	-113	92.83	-2.4445	
橡胶	12210	-50	11.32	-0.0697	
塑料	8138	-115	34.17	-4.2179	

### 2. 期权市场情况

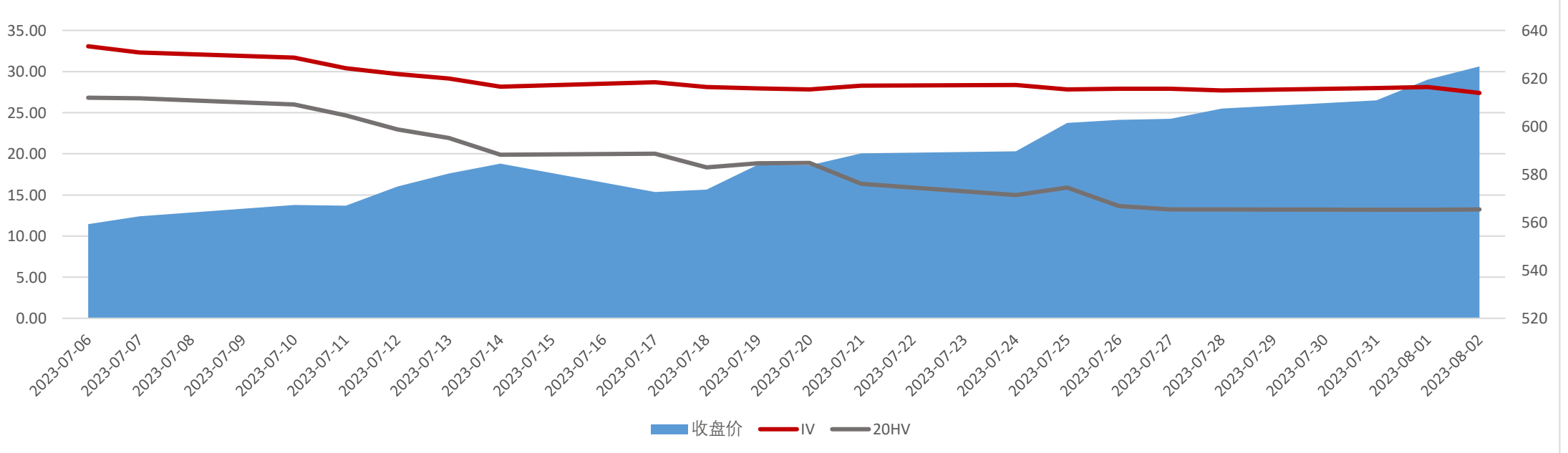
	主力合约	剩余日	持仓量PCR	变化	成交额PCR	变化
原油	SC2309. INE	8	1.36	0.14	0.82	0.17
甲醇	MA309. CZC	88	1.05	0.19	1.06	0.53
PTA	TA309. CZC	88	0.70	0.11	0.78	0.27
聚丙烯	PP2309. DCE	3	0.38	0.03	0.56	-0.13
PVC	V2309. DCE	2	0.99	0.52	1.17	0.66
橡胶	RU2309. SHF	17	0.31	0.08	0.46	0.10
塑料	L2309. DCE	2	0.61	0.21	1.43	1.01

### 3. 期权量化指标

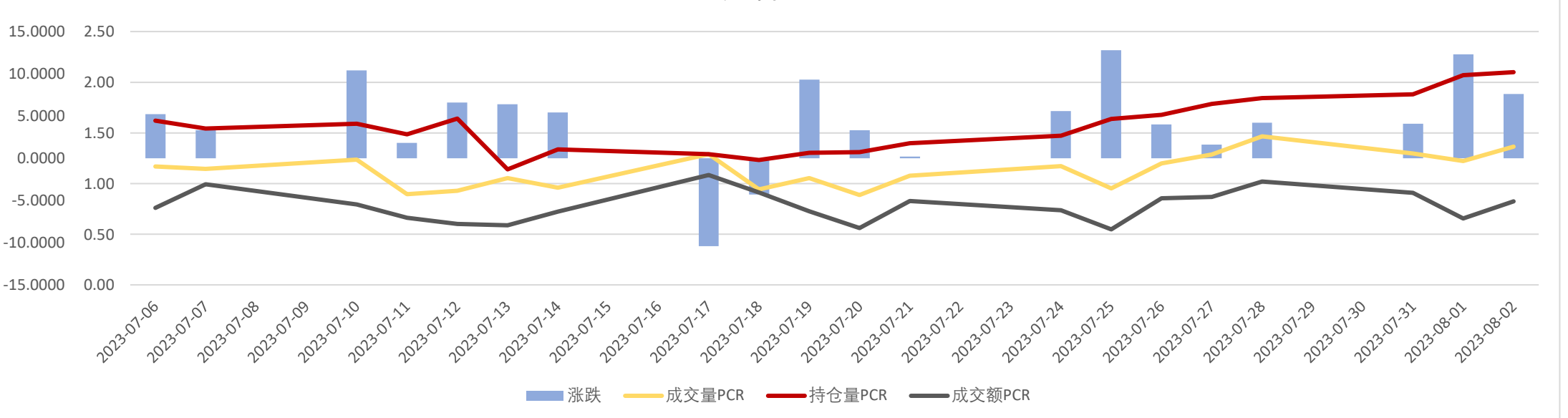
	IV	20HV	IV-20HV	50分位	IV-20HV变化
原油	27.40	13.23	14.17	36.34	
甲醇	22.18	31.05	-8.87	28.68	
PTA	21.75	20.01	1.74	30.18	
聚丙烯	18.40	14.91	3.49	17.95	
PVC	21.50	20.30	1.20	22.71	
橡胶	22.67	15.10	7.56	20.12	
塑料	16.18	10.67	5.51	17.93	

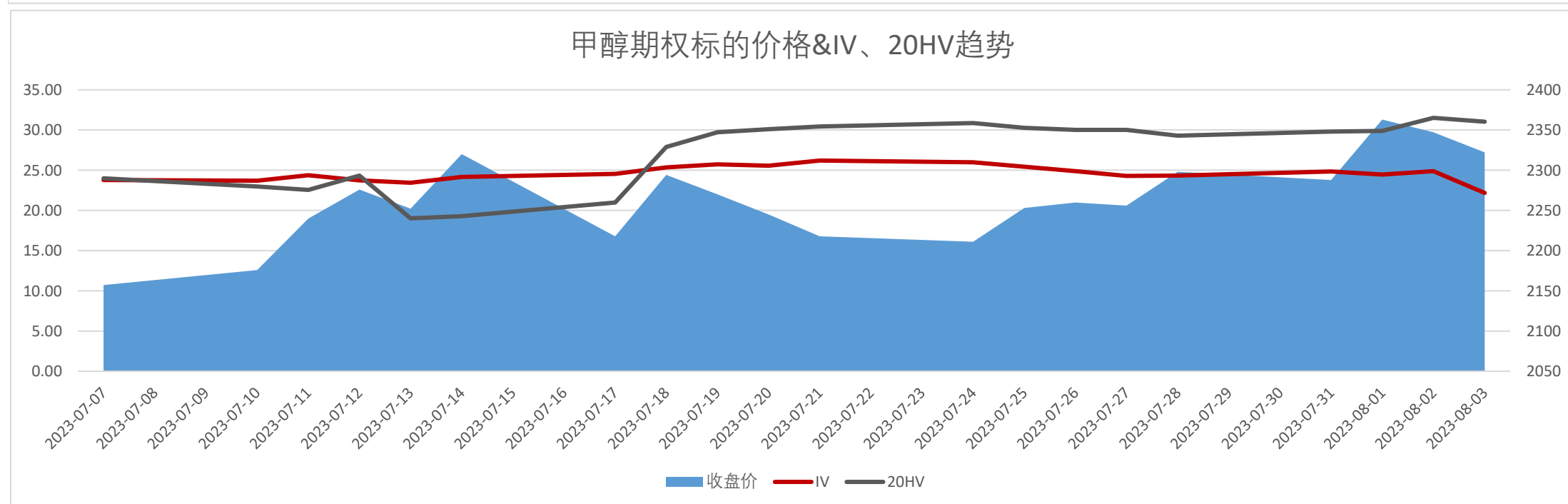
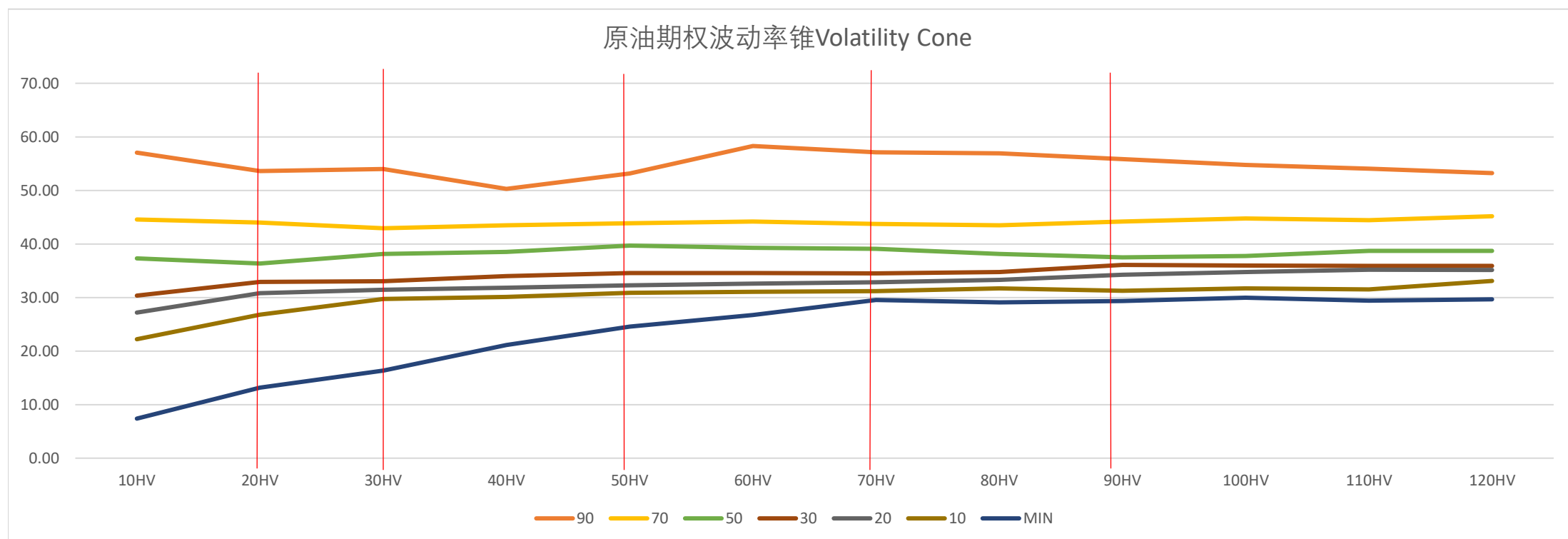
### 4. 数据图表

原油期权标的的价格&IV、20HV趋势



原油主力合约期权PCR





## 黑色&金属 (9)

### 1. 标的情况

	标的收盘价	涨跌	成交量变化/万	持仓量变化/万	5日趋势
铁矿石	831	-9	33.23	-1.7033	
螺纹钢	3801	-57	224.67	6.6048	
沪金	454.36	-1.24	0.01	-0.0036	
沪铜	69530	-1170	2.35	-0.799	
沪铝	18460	-80	18.27	-1.6861	
沪锌	21055	-95	16.28	-0.4165	
沪银	5774	-51	58.97	-0.4104	
工业硅	13290	-535	7.12	-1.6894	
碳酸锂	228550	100	1.61	-0.0054	

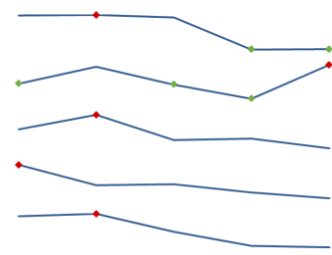
### 2. 期权市场情况

	主力合约	剩余日	持仓量PCR	变化	成交额PCR	变化
铁矿石	I2309.DCE	3	1.11	0.00	1.17	0.25
螺纹钢	RB2310.SHF	36	0.72	0.17	0.76	0.23
沪金	AU2309.SHF	17	0.94	0.14	0.59	-0.10
沪铜	CU2308.SHF	17	0.65	0.05	0.68	0.12
沪铝	AL2309.SHF	17	0.80	0.24	0.91	0.36
沪锌	ZN2309.SHF	17	0.80	0.18	0.63	0.24
沪银	AG2310.SHF	37	0.70	0.13	0.73	0.28
工业硅	SI2309.GFE	2	0.43	0.18	1.43	0.75
碳酸锂	LC2401.GFE	85	0.93	0.00	0.65	-0.07

### 3. 期权量化指标

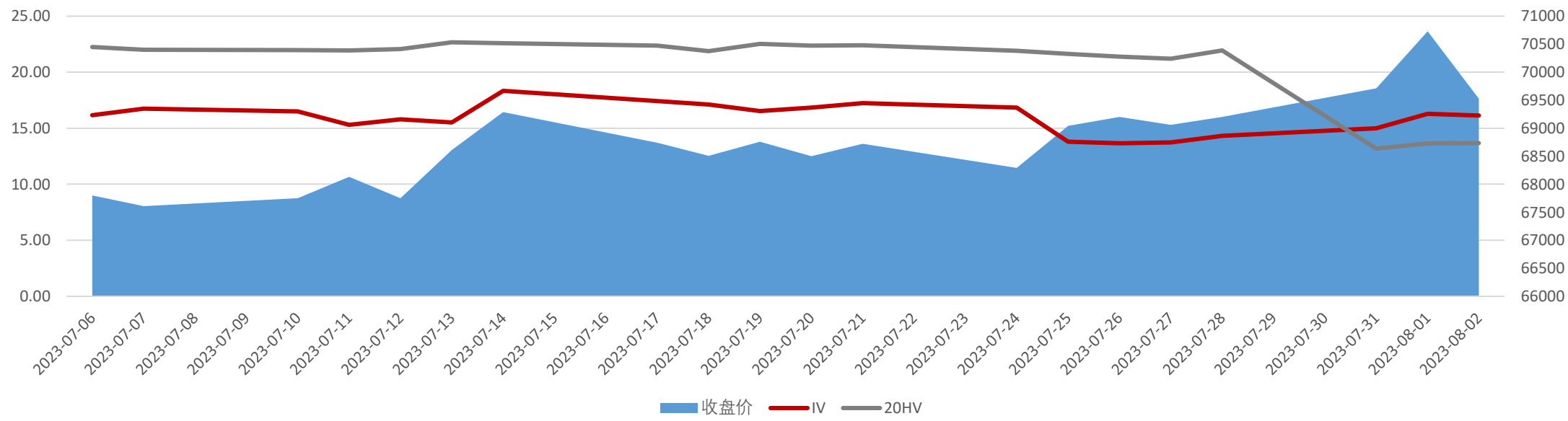
	IV	20HV	IV-20HV	50分位	IV-20HV变化
铁矿石	31.72	19.76	11.95	25.86	
螺纹钢	19.72	18.45	1.27	25.93	
沪金	12.47	7.82	4.65	10.53	

沪铜	16.12	13.68	2.45	20.67
沪铝	11.38	7.67	3.72	20.99
沪锌	17.35	17.57	-0.23	19.35
沪银	21.21	7.61	13.60	10.53
工业硅	27.29	7.82	19.47	10.53

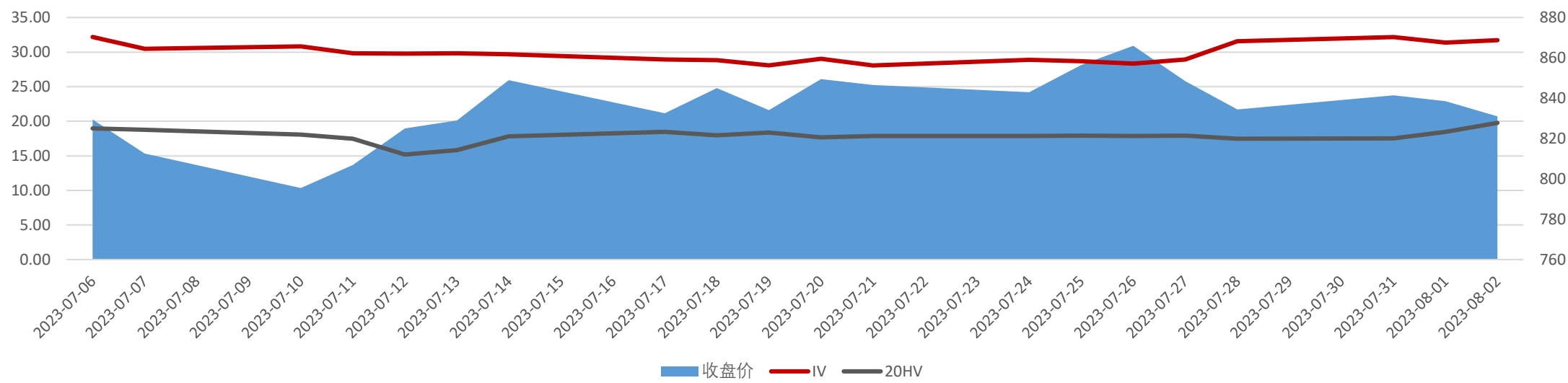


#### 4. 数据图表

### 沪铜期权标的的价格&IV、20HV趋势



### 铁矿石期权标的的价格&IV、20HV趋势



## 免责声明

本报告由中辉期货研发中心编制

本报告所载的资料、工具及材料只提供给阁下作参考之用，不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。本报告的信息均来源于公开资料，中辉期货对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所含的信息和建议不会发生任何变更。阁下首先应明确不能依赖本报告而取代个人的独立判断，其次期货投资风险应完全由实际操作者承担。除非法律或规则规定必须承担的责任外，中辉期货不对因使用本报告而引起的损失负任何责任。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中辉期货的立场。中辉期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告以往的表现不应作为日后表现的反映及担保。本报告所载的资料、意见及推测反映中辉期货于最初发表此报告日期当日的判断，可随时更改。本报告所指的期货品种的价格、价值及投资收入可能会波动。中辉期货未参与报告所提及的投资品种的交易及投资，不存在与客户之间的利害冲突。本报告的版权属中辉期货，除非另有说明，报告中使用材料的版权亦属中辉期货。未经中辉期货事先书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布，亦不得作为诉讼、仲裁、传媒及任何单位或个人引用之证明或依据，不得用于未经允许的其它任何用途。如引用、刊发，需注明出处为中辉期货有限公司，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。所有于本报告中使用的商标、服务标记及标识均为中辉期货有限公司的商标、服务标记及标识。

期货有风险，投资需谨慎！

研究员	联系方式	资格证号	咨询证号	
	游达锦	15618833051	F3074418	Z0019331
	刘潇钰	18559306571	F3082462	

中辉期货有限公司 400-006-6688