

000799东方

内容导航：

000799东方 要点：10月28日，两市延续震荡下挫。http://www.hibor.com.cn【慧博投研资讯】截至收盘沪指跌1.23%，深成指跌1.03%，沪深300跌0.69%。http://www.hibor.com.cn（慧博投研资讯）两市成交额11076.91亿。IH、IF、IC涨跌不一，IH、IF小幅升水。各品种期权主力合约购沽隐波低位震荡，50合成标的仍升水，期权市场情绪偏积极。50ETF期权总成交量为1700306，总持仓量为2400634，总成交额10.623亿。沪深300三个期权产品：股指期权总成交量为79824手，持仓量为158521手，总成交额6.249亿。沪300ETF期权成交量1160640手，总持仓量为1578794手，总成交额10.550亿。深300ETF期权成交量184216手，持仓量为274213手，总成交额1.187亿。消息面上，1、白皮书：加快构建碳达峰碳中和“1+N”政策体系。《中国应对气候变化的政策与行动》白皮书介绍，中国实施积极应对气候变化国家战略。不断提高应对气候变化力度，强化自主贡献目标，加快构建碳达峰碳中和“1+N”政策体系。坚定走绿色低碳发展道路，实施减污降碳协同治理，积极探索低碳发展新模式。加大温室气体排放控制力度，有效控制重点工业行业温室气体排放。持续推进全国碳市场建设，建立温室气体自愿减排交易机制。2、美取消中国电信运营牌照，商务部回应。针对美国联邦通信委员会决定取消中国电信公司在美电信运营牌照一事，商务部新闻发言人束珏婷回应，美方此举泛化国家安全概念，滥用国家力量，在缺乏事实依据的情况下恶意打压中国企业，违背市场原则，破坏双方合作氛围，中方对此表示严重关切。中方经贸团队已就此向美方提出严正交涉。中方将继续采取必要措施，维护中国企业的正当权益。3、国家发展改革委召开会议研究煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的界定标准。国家发展改革委价格司连续召开会议，邀请经济、法律方面专家，以及部分煤炭、电力行业协会和企业，专题研究如何界定煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的判断标准。会议听取了相关行业协会和企业近年来煤炭生产经营情况汇报，集中讨论了促进煤炭行业与下游电力等产业协调可持续发展应保持的合理价格区间和利润率水平，着重研究了认定煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的具体认定标准和方法。两市延续走弱，量能维持在万亿附近。期权市场方面，购沽隐波窄幅震荡，合成标的仍升水，期权市场情绪偏暖。操作策略上，短线关注50可持续性，构建价差策略，防范Vega风险。中长期来看，当下或是抄底良机。建议卖出看跌期权或构建备兑策略。

000799东方 要点：10月28日，两市延续震荡下挫。http://www.hibor.com.cn【慧博投研资讯】截至收盘沪指跌1.23%，深成指跌1.03%，沪深300跌0.69%。http://www.hibor.com.cn（慧博投研资讯）两市成交额11076.91亿。IH、IF、IC涨跌不一，IH、IF小幅升水。各品种期权主力合约购沽隐波低位震荡，50合

成标的仍升水，期权市场情绪偏积极。50ETF期权总成交量为1700306，总持仓量为2400634，总成交额10.623亿。沪深300三个期权产品：股指期权总成交量为79824手，持仓量为158521手，总成交额6.249亿。沪300ETF期权成交量1160640手，总持仓量为1578794手，总成交额10.550亿。深300ETF期权成交量184216手，持仓量为274213手，总成交额1.187亿。消息面上，

- 1、白皮书：加快构建碳达峰碳中和“1+N”政策体系。《中国应对气候变化的政策与行动》白皮书介绍，中国实施积极应对气候变化国家战略。不断提高应对气候变化力度，强化自主贡献目标，加快构建碳达峰碳中和“1+N”政策体系。坚定走绿色低碳发展道路，实施减污降碳协同治理，积极探索低碳发展新模式。加大温室气体排放控制力度，有效控制重点工业行业温室气体排放。持续推进全国碳市场建设，建立温室气体自愿减排交易机制。
- 2、美取消中国电信运营牌照，商务部回应。针对美国联邦通信委员会决定取消中国电信公司在美电信运营牌照一事，商务部新闻发言人束珏婷回应，美方此举泛化国家安全概念，滥用国家力量，在缺乏事实依据的情况下恶意打压中国企业，违背市场原则，破坏双方合作氛围，中方对此表示严重关切。中方经贸团队已就此向美方提出严正交涉。中方将继续采取必要措施，维护中国企业的正当权益。
- 3、国家发展改革委召开会议研究煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的界定标准。国家发展改革委价格司连续召开会议，邀请经济、法律方面专家，以及部分煤炭、电力行业协会和企业，专题研究如何界定煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的判断标准。会议听取了相关行业协会和企业近年来煤炭生产经营情况汇报，集中讨论了促进煤炭行业与下游电力等产业协调可持续发展应保持的合理价格区间和利润率水平，着重研究了认定煤炭企业哄抬价格、牟取暴利的具体认定标准和方法。

两市延续走弱，量能维持在万亿附近。期权市场方面，购沽隐波窄幅震荡，合成标的仍升水，期权市场情绪偏暖。操作策略上，短线关注50可持续性，构建价差策略，防范Vega风险。中长期来看，当下或

是抄底良机。建议卖出看跌期权或构建备兑策略。