

2021

# 上海证券交易所 股票期权市场发展报告



创新产品部

## 目录

摘要.....	4
一、市场篇.....	7
（一） 市场概况.....	7
（二） 投资者.....	9
（三） 交易参与人.....	11
（四） 做市商.....	15
二、组织篇.....	19
（一） 运行管理.....	19
（二） 发展与创新.....	20
（三） 市场推广.....	20
三、监管篇.....	23
四、展望篇.....	26
附录.....	28



## 摘要

股票期权是金融市场重要的风险管理工具,在稳定现货市场、提高定价效率、降低交易成本等方面具有重要作用。股票期权市场是我国资本市场重要的组成部分,在服务实体经济方面发挥着特有的作用。上交所现有上证 50ETF 期权和沪深 300ETF 期权两只期权产品。2021 年,上交所股票期权市场运行平稳,定价合理,规模稳步增长,经济功能日益显现。全年,ETF 期权合约累计成交 10.97 亿张,其中认购期权 5.91 亿张,认沽期权 5.06 亿张,日均成交 451.60 万张,日均持仓 500.42 万张。累计成交面值 46.03 万亿元,日均成交面值 1894.32 亿元,累计权利金成交 8233.28 亿元,日均权利金成交 33.88 亿元。市场日均成交持仓比为 0.92,日均期现成交比为 0.28,日均受保现货市值为 315.10 亿元,单日受保市值最高达到 435.57 亿元。股票期权投资者人数稳步增长,年末期权投资者账户总数达到 54.24 万。投资者认购期权交易量和认沽期权交易量分别占总交易量的 53.88%和 46.12%。个人投资者和机构投资者交易量占总交易量比例分别为 39.32%和 60.68%。期权经营机构经纪业务总成交量为 13.80 亿张(双向),占全市场总成交量的 62.88%。主做市商日均成交 326.69 万张(双向),占全市场的 36.17%,日均持仓 124.41 万张(双向),占全市场的 12.43%,在提供流动性和保障合理定价方面发挥了重要作用。

在运行管理方面，上交所进一步强化和提升股票期权交易运行管理水平，完善期权安全运行体系，进一步防范运行风险，顺利完成了疫情应对、建党百年等重要时期的特别保障工作。

在创新发展方面，上交所持续优化期权交易机制，推出了做市商双边报价指令机制，进一步提升了期权做市商报价效率，降低了技术资源占用。从总体上看，优化成效显著，做市商双边报价指令业务的市场参与情况良好。

在市场监管与风控方面，上交所扎实推进相关工作，确保全年衡量市场质量和风险情况的各项指标均处于合理水平，市场整体风险可控。上交所从市场监测与分析、市场结算和交收风险防控、舆情监控与引导等方面加强股票期权市场监管，进一步完善了相关应急处置流程，妥善应对个别虚值合约涨幅较大等情形，确保全年期权市场平稳运行。

在市场推广方面，尽管面临疫情防控常态化形势，上交所积极探索创新期权投资者教育推广方式和内容，针对各类市场参与者开展了一系列培育推广工作，包括创新采用线上投教模式、组织业务交流沙龙、开展知识竞答、举办股票期权种子讲师训练营、联合高校开展期权精品课堂、完善期权学苑网站及其 APP、优化“上交所期权之家”微信公众号等，多渠道、多形式拓展宣传推广覆盖范围，为投资者提供更全面更系统更便利的服务。



# 一、市场篇

## （一）市场概况

截至 2021 年末，上交所 ETF 期权合约累计成交 10.97 亿张，其中认购期权 5.91 亿张，认沽期权 5.06 亿张，日均成交 451.60 万张，日均持仓 500.42 万张。累计成交面值 46.03 万亿元，日均成交面值 1894.32 亿元，累计权利金成交 8233.28 亿元，日均权利金成交 33.88 亿元。全年，中国波指 iVX<sup>®</sup> 及 50VX<sup>®</sup>、300VX<sup>®</sup> 运行平稳，较好反映了市场风险水平。

目前，上证 50ETF 期权和沪深 300ETF 期权已经成为全球主要的 ETF 期权品种。2021 年，上证 50ETF 期权合约全年累计成交 6.29 亿张，其中认购期权 3.46 亿张，认沽期权 2.83 亿张，日均成交 258.99 万张，单日最大成交 556.90 万张。年末持仓 302.07 万张，日均持仓 305.10 万张，单日最大持仓 411.61 万张。累计成交面值 21.87 万亿元，日均成交面值 900.08 亿元，累计权利金成交 3875.64 亿元，日均权利金成交 15.95 亿元。更为详细的数据参见附表 1。

2021 年，沪深 300ETF 期权合约累计成交 4.68 亿张，其中认购期权 2.45 亿张，认沽期权 2.23 亿张，日均成交 192.61 万张，单日最大成交 414.14 万张。年末持仓 182.44 万张，日均持仓 195.32 万张，单日最大持仓 244.20 万张。累计成交面值 24.16 万亿元，日均成交面值 994.24 亿元，累计权利金成交 4357.64

亿元,日均权利金成交 17.93 亿元。更为详细的数据参见附表 2。

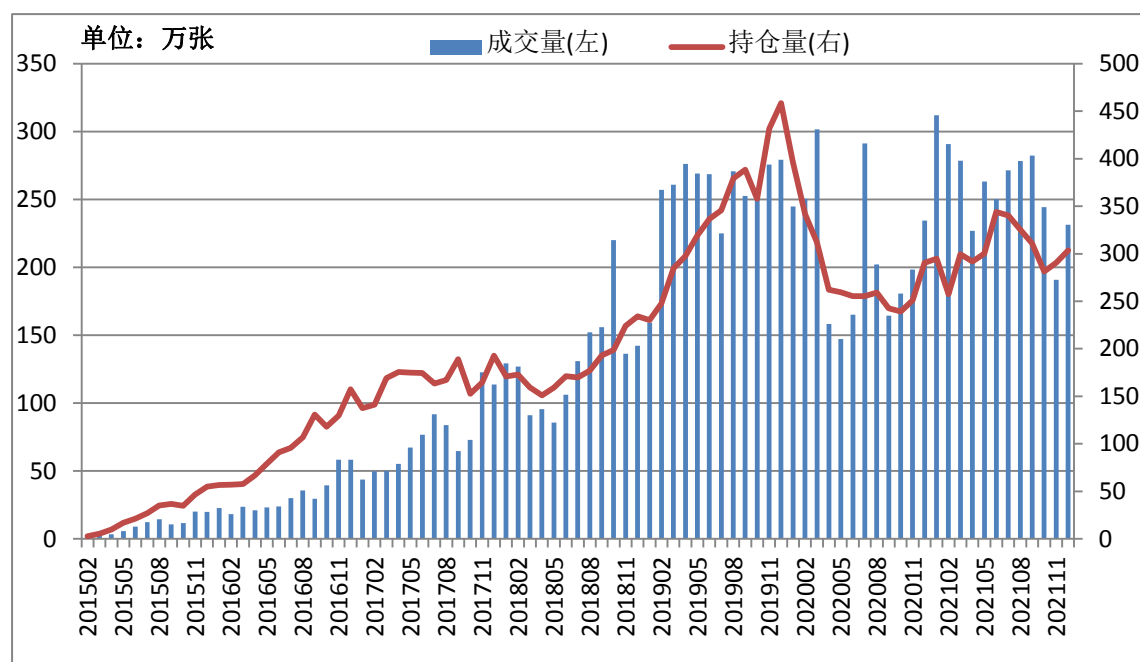


图 1 上证 50ETF 期权历年逐月日均成交量及日均未平仓合约数情况  
(2015 年 02 月-2021 年 12 月)

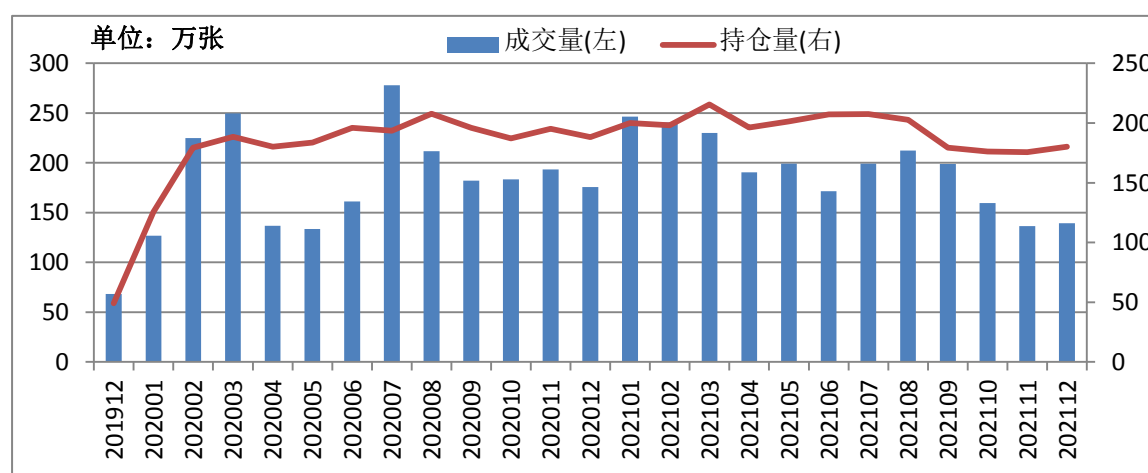


图 2 沪深 300ETF 期权历年逐月日均成交量及日均未平仓合约数情况  
(2019 年 12 月-2021 年 12 月)

2021 年,上交所期权市场日均成交持仓比为 0.92,日均期  
现成交比为 0.28,投机交易(方向性交易)占比为 18.71%。2021  
年,期权市场质量指数平均值为 125.62(100 以上代表流动性好、  
定价效率高),市场质量逐步改善;期权市场风险指数平均值为



33.99（60 以下代表风险较小），市场风险较小。市场日均受保市值为 315.10 亿元，单日受保市值最高达到 435.57 亿元。

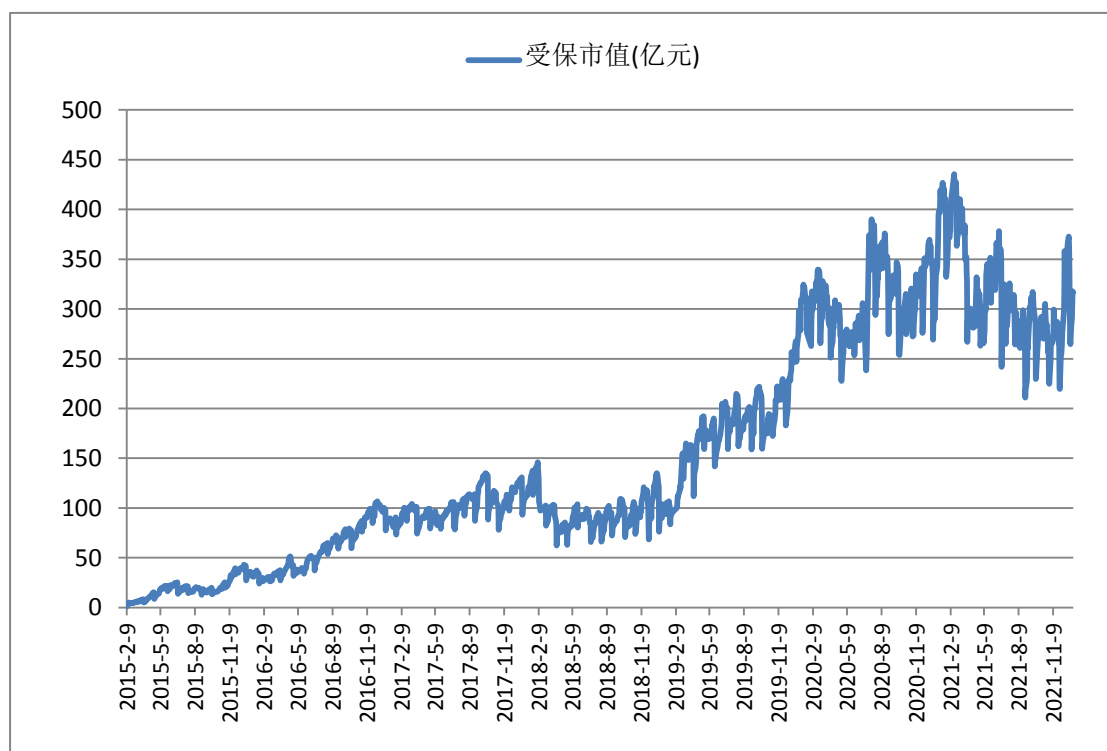


图 3 市场日均受保市值（2015-2021）

## （二）投资者

截至 2021 年末，上交所期权投资者账户总数为 54.24 万，年内新增 5.28 万户，月均新增 4396 户。

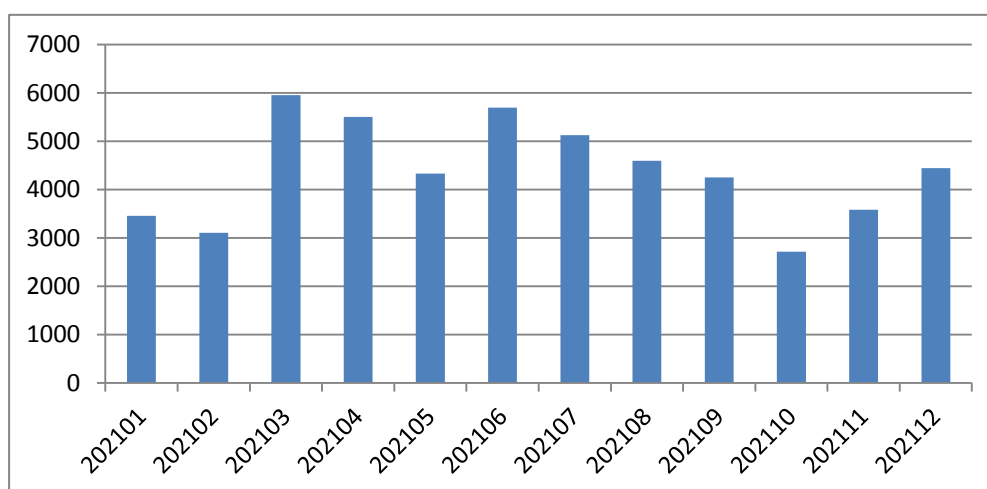


图 4 2021 年期权经营机构月度净新增账户数（单位：户）

从交易的期权合约类型来看，全年认购期权交易量占总交易量的 53.88%，认沽期权交易量占总交易量的 46.12%。认购期权交易中，个人投资者交易量占比为 41.22%，机构投资者交易量占比为 58.78%。认沽期权交易中，个人投资者交易量占比为 37.11%，机构投资者交易量占比为 62.89%。

从期权买卖方向来看，个人投资者偏好买入开仓，占其所有开仓交易的 61.63%。机构投资者偏好卖出开仓(不含备兑开仓)，占其所有开仓交易的 78.92%。个人投资者进行的备兑开仓交易占全部备兑开仓交易的 60.46%。期权市场 2021 年不同类型投资者交易偏好情况见表 1。

表 1 2021 年期权市场不同类型投资者交易偏好

	个人投资者	机构投资者	全部投资者占
买入开仓	12.62%	6.89%	19.51%
卖出开仓	7.83%	25.86%	33.69%
备兑开仓	0.03%	0.02%	0.05%
买入平仓	7.19%	23.25%	30.44%
卖出平仓	11.62%	4.64%	16.26%
备兑平仓	0.03%	0.02%	0.05%
合计	39.32%	60.68%	100.00%

从交易目的看，保险、增强收益、套利和方向性交易四类交

易行为占比分别为 8.84%、51.07%、18.38%、18.71%，其中增强收益的占比较高。从投资者类别看，机构投资者主要以增强收益和套利交易为主，个人投资者则主要以增强收益和方向性交易为主。

### （三）交易参与者

截至 2021 年底，共有 90 家证券公司和 32 家期货公司取得了上交所股票期权交易参与者资格并开通了期权经纪业务交易权限，其中有 63 家证券公司开通了期权自营业务交易权限。期权经营机构不同业务类型股票期权成交量情况见表 2。

表 2 期权经营机构股票期权成交量情况

公司类型	业务类型	2021 年 (万张, 双向)
证券公司	经纪业务成交量	85830.96
	自营业务成交量	1891.09
	做市业务成交量	78350.44
期货公司	经纪业务成交量	52180.10
	做市业务成交量	1225.71
合计(万张, 单向)		109739.15

(注：股票期权成交量包括上证 50ETF 期权和沪深 300ETF 期权)

#### 1. 经纪业务

2021年，期权经营机构经纪业务总成交量为13.80亿张（双向），占全市场总成交量的62.88%。2021年期权经营机构经纪业务成交量和累计开户数前十名的情况见表3。

表3 2021年期权经营机构经纪业务前十名情况

排名	当年成交量		累计开户数	
	公司名称	市场份额	公司名称	市场份额
1	鲁证期货	7.84%	招商证券	8.73%
2	南华期货	7.75%	广发证券	7.77%
3	国泰君安期货	5.67%	银河证券	6.45%
4	华泰证券	5.06%	国泰君安证券	5.70%
5	华宝证券	3.89%	国信证券	5.05%
6	中信证券	3.79%	安信证券	4.57%
7	银河证券	3.03%	华泰证券	4.50%
8	海通期货	3.00%	平安证券	4.32%
9	招商证券	2.75%	长江证券	3.91%
10	广发证券	2.65%	方正证券	3.82%
合计	-	45.45%	-	54.83%

（注：累计开户数指股票期权业务上线至2021年底的开户数量）

证券公司股票期权经纪业务成交量为85830.96万张（双向），

占全市场总成交量的 39.11%。证券公司累计开立股票期权经纪业务账户 53.37 万户，占全市场总开户数的 98.38%，较 2020 年底新增 5.16 万户。股票期权经纪业务成交量排名前十的证券公司累计成交量 42804.03 万张（双向），占全市场经纪业务总成交量的 31.01%，累计开户数排名前十的证券公司总开户数 29.73 万户，占全市场经纪业务账户数的 54.83%。2021 年证券公司经纪业务成交量和累计开户数前十名的情况见表 4。

表 4 2021 年证券公司经纪业务前十名情况

排名	当年成交量		累计开户数	
	公司名称	市场份额	公司名称	市场份额
1	华泰证券	5.06%	招商证券	8.73%
2	华宝证券	3.89%	广发证券	7.77%
3	中信证券	3.79%	银河证券	6.45%
4	银河证券	3.03%	国泰君安证券	5.70%
5	招商证券	2.75%	国信证券	5.05%
6	广发证券	2.65%	安信证券	4.57%
7	海通证券	2.63%	华泰证券	4.50%
8	国泰君安证券	2.62%	平安证券	4.32%
9	方正证券	2.48%	长江证券	3.91%
10	国信证券	2.11%	方正证券	3.82%
合计	-	31.01%	-	54.83%

（注：累计开户数指股票期权业务上线至 2021 年底的开户数量）

期货公司经纪业务成交量为 52180.10 万张（双向），占全市

场总成交量的 23.77%。

截至 2021 年底，期货公司共开立期权经纪业务账户 8564 户，占全市场总开户数的 1.58%，较 2020 年底增加了 1108 户。期货公司交易量和开户数分布也较集中，成交量排名前五的期货公司累计成交 36897.25 万张（双向），占全市场经纪业务成交量的 26.73%；累计开户数排名前五的期货公司总开户数为 3820 户，占全市场经纪业务账户数的 0.70%。2021 年期货公司经纪业务成交量及累计开户数前五名的情况见表 5。

表 5 2021 年期货公司经纪业务前五名情况

排名	当年成交量		累计开户数	
	公司名称	市场份额	公司名称	市场份额
1	鲁证期货	7.84%	银河期货	0.17%
2	南华期货	7.75%	南华期货	0.16%
3	国泰君安期货	5.67%	方正中期期货	0.13%
4	海通期货	3.00%	永安期货	0.12%
5	银河期货	2.46%	光大期货	0.12%
合计	-	26.73%	-	0.70%

（注：累计开户数指股票期权业务上线至 2021 年底的开户数量）

## 2. 自营业务

证券公司自营业务（不含做市商）累计成交 1891.09 万张（双

向)，占全市场成交量的 0.86%。自营业务成交量排名前五的证券公司成交占比合计为 44.06%。

#### （四） 做市商

截至 2021 年底，上证 50ETF 期权共有 18 家做市商，其中，主做市商 14 家（东方证券、光大证券、广发证券、国泰君安证券、国信证券、海通资源、海通证券、华泰证券、申万宏源证券、招商证券、中泰证券、中信建投证券、中信中证、中信证券）；一般做市商 4 家（长江证券、西部证券、永安资本、银河德睿）。

沪深 300ETF 期权共有 17 家做市商，其中，主做市商 13 家（东方证券、光大证券、广发证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、申万宏源证券、招商证券、中泰证券、中信建投证券、中信中证、中信证券）；一般做市商 4 家（长江证券、西部证券、永安资本、银河德睿）。

2021 年，做市商运行平稳，未发生市场风险事件，整体上较好地履行了各项做市义务，在提供流动性和保障合理定价等方面发挥了重要作用。在成交量方面，主做市商日均成交 326.69 万张（双向），占全市场的 36.17%；日均持仓 124.41 万张（双向），占全市场的 12.43%；日均申报 23500.85 万张，占全市场的 93.38%。2021 年，做市商之间、做市商与投资者之间以及投资者之间的成交占比分别为 8.89%、54.73%和 36.38%，市场各主体之间的成交占比情况合理。

2021 年，做市商义务履行情况良好，对做市业务的积极参

与，使得市场功能得到有效发挥。主做市商时间加权平均报价差率平均为 33.92%，加权平均参与率平均为 94.59%，均优于做市商基本义务要求。2021 年，上证 50ETF 期权 14 家主做市商中 7 家年度评级结果为 AA，7 家年度评级结果为 A，沪深 300ETF 期权 13 家主做市商中 7 家年度评级结果为 AA，6 家年度评级结果为 A，所有主做市商所有月份评级均在 A 或 A 以上。2021 年上交所股票期权主做市商评级情况见表 6 及表 7。

表 6 2021 年上证 50ETF 期权主做市商月度评级及年度评级

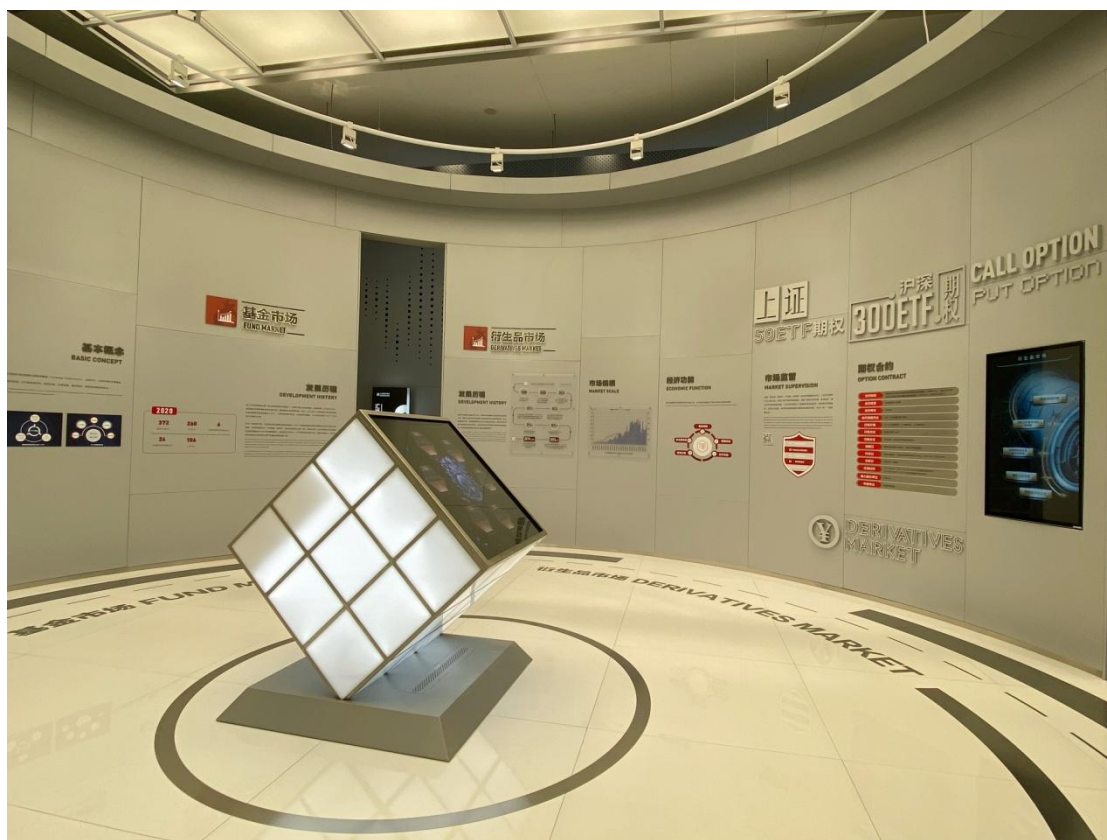
名称	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
广发证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
国泰君安 证券	A	A	A	A	AA	AA	AA	AA	A	AA	AA	AA	AA
华泰证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
招商证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
中泰证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	A	AA
中信建投 证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
中信证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
东方证券	A	A	A	A	A	A	A	A	AA	AA	A	AA	A
光大证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
国信证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
海通资源	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
海通证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
申万宏源 证券	A	A	A	A	A	A	A	A	AA	AA	AA	AA	A



中信中证	A	A	AA	AA	A	A	A	A	A	A	A	A	A
------	---	---	----	----	---	---	---	---	---	---	---	---	---

表 7 2021 年沪深 300ETF 期权主做市商月度评级及年度评级

名称	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
广发证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
国泰君安 证券	A	A	A	A	AA	AA	AA	AA	A	A	AA	AA	AA
华泰证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
招商证券	AA	AA	AA	AA	A	AA	AA	AA	AA	AA	AA	A	AA
中泰证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	A	AA	AA	A	AA
中信建投 证券	AA	AA	AA	AA	A	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
中信证券	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA	AA
东方证券	A	A	A	A	A	A	A	A	AA	AA	AA	AA	A
光大证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
国信证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
海通证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
申万宏源 证券	A	A	A	A	A	A	A	A	A	AA	AA	AA	A
中信中证	A	A	A	AA	A	A	A	A	A	A	A	A	A



## 二、组织篇

### （一）运行管理

为确保期权市场交易运行的安全、可靠和高效，上交所进一步强化和提升股票期权交易运行管理水平，强化运行管理操作制度，加强人员配置和培训，梳理期权安全运行风险，完善期权安全运行体系，进一步防范运行风险。2021年，顺利完成了疫情挑战应对、建党百年等重要时期的特别保障工作。

2021年全年，50ETF及300ETF期权平稳运行243天，没有发生运行安全事件。1月18日沪深300ETF股票期权上市以来首次分红，11月29日上证50ETF在股票期权上市以来第六次分红，上交所均顺利完成期权合约调整相关工作。2021年全年，上证50ETF及300ETF期权合约新挂794个（波动加挂218个、到期加挂432个、调整加挂144个），合约摘牌802个，合约除权除息调整200个，合约提醒4964个（到期提醒3964个、除息调整提醒1000个）。完成做市商账户调整4个，账户持仓限额调整14个。

为提高期权市场应急处置能力，2021年上交所在期权全真模拟交易环境组织了18次推演和6次应急实操演练，新增和整合修订相关的期权应急预案，优化了期权突发事件应急处置措施，有效加强了应急保障力度；组织了期权标的调入调出演练、保证金不足强平演练、行权指令合并优化功能、合约日期调整、交易参数调整和自动化专项测试。

## （二） 发展与创新

为促进期权市场稳定有序健康发展，上交所不断推进期权机制优化工作。2021年2月1日，上交所推出了期权做市商双边报价指令机制，进一步提升期权做市商报价效率，降低技术资源占用。从总体上看，做市商双边报价指令业务的市场参与情况良好，有助于做市商市场功能更好发挥，期权交易系统内存日均实际占用量较之前有了明显降低，优化成效显著。

## （三） 市场推广

2021年，上交所在市场各方的大力支持下，积极探索创新期权投资者教育推广方式和内容，通过线上、线下多种形式开展了一系列市场培育与推广工作，取得了阶段性的成果。全年，上交所在全国范围内共进行期权线下推广387次，累计培训9400余名投资者和4400名从业人员。在疫情防控常态化的背景下，本所采用线上直播、高峰论坛、制作视频、开展知识竞答等方式，多渠道、多形式开展期权投教推广工作，拓展投教覆盖范围。全年，上交所期权市场推广工作呈现以下特点：

**一是培训覆盖面持续扩大。**在经历新冠疫情冲击下，上交所创新线上投教模式，联合市场机构实现了更大规模的远程期权投教工作，线上投资者参与互动活跃。全年，线下培训共举办387场，面向个人投资者、机构投资者、期权投顾、交易员等不同人群，培训人次较去年同比增长约40%。

**二是数字化转型成效初显。**今年，上交所持续完善期权学苑

网站及其 APP 的维护与管理。对期权学苑的内容进行了更为全面的优化，增加了共计 34 节课、17 小时的课程内容，相关课程设计由入门至进阶，帮助投资者全方位了解期权知识策略。

**三是建立可持续机构服务机制。**上交所通过服务专员反馈机制实时了解一线机构的需求，并对相关需求采取闭环反馈式管理。针对机构反映较多的期权讲师人才匮乏问题，上交所已连续举办两届期权百强营业部种子讲师训练营，市场反响较好。此外，也致力为同业建立沟通交流通道，多次邀请市场机构联合举办业务交流沙龙。

**四是主题活动异彩纷呈。**2021 年，上交所组织了期权 6 周年系列活动，进行了年度优秀期权讲师、优秀期权投顾、期权百强营业部的评选工作。同时，上交所持续推动线上期权投教与市场推广活动。一方面，开展线上期权专题知识竞答，激发了投资者的积极性，线上参与热度持续上升。另一方面，继续通过“上交所期权之家”微信公众号进行贴近投资者的市场培育工作，定期发布股票期权交易信息与期权投教知识，并鼓励投资者积极留言互动，努力将微信公众号打造成与投资者互动交流的高效平台。截至 2021 年末，“上交所期权之家”微信公众号订阅人数接近 17 万人，较上一年末同比增长 10.48%。

**五是人才培养机制形成。**2021 年，上交所继续与北京大学、清华大学、上海交通大学、浙江大学等高校合作开展期权精品课堂，为千余名高校学生提供了体系化的期权知识教育。全年，联

合 20 余所高校授课共 34 节，课后学生普遍反馈课程效果优良，期权精品课堂的开设为行业发展培养了一批极富潜力的人才。



### 三、监管篇

2021年，上交所认真落实“建制度、不干预、零容忍”的要求，秉持“四个敬畏，一个合力”的工作作风，扎实推进期权市场监管工作，市场运行平稳，风险可控。全年监控预警1.8万余次，日均处理预警74次，发布市场提醒公告72次。2021年上交所期权一线监管工作主要包括以下七个方面：

**一是加强宏观监控，严防投机炒作风险。**上交所从市场监测与分析、市场结算和交收风险防控、舆情监控与引导等方面加强股票期权市场监管，进一步完善了相关应急处置流程，妥善应对个别虚值合约涨幅较大等情形，确保全年期权市场平稳运行，特别是在“七一”建党百年庆典期间，圆满完成各项特别保障工作。

**二是继续加大对程序交易的监管与处置力度。**上交所针对程序交易制定了全面的监管制度，进行事前、事中、事后严格监管。针对程序交易特点专门设计了监控指标，专人专岗监控，做到实时发现、核查与处置。每日对程序化交易未报备账户进行筛查，及时发现并处置未报备账户。2021年，上交所对程序化交易账户异常交易行为采取口头警示160余次、书面警示20余次，处置程序化交易未报备账户12个。

**三是打击非法分仓平台，排除期权市场长期发展隐患。**2021年，上交所继续利用大数据手段核查分仓账户交易行为、挖掘疑似账户，排查和处置期权经营机构系统安全漏洞。目前，相关账户均已被限制交易或者注销，分仓交易平台的监管工作取得阶段性进展。

**四是完善风险预警体系，提高风控有效性。**上交所结合信息技术与大数据分析方法，对风险预警体系效果进行全面评估和优化，累计优化预警指标 20 余项，新增预警功能 80 余项，进一步提升期权市场风险监测水平与风险管理能力。

**五是多措并举提升期权市场科技监管水平。**2021 年，根据市场发展情况及监管需要，上交所搭建历史监管信息库，实现监管信息自动化记录，打通线索单处理与函件发送的连接通道，提升监管效率。同时，上交所全面梳理期权市场风险点，充分利用大数据等新一代技术，持续推进期权风控系统升级改造，全面提升上交所期权市场风险管理能力和科技监管水平。

**六是持续完善期权经营机构业务管理。**2021 年，上交所共进行了 1 次股票期权经纪业务检查，4 次期权做市业务检查，对 20 余家机构经纪、自营、做市业务申请或测试环境接入进行辅导，全年新增期权交易参与人 2 家。

**七是跟踪研究衍生品舆情热点，防范风险跨市场传导。**2021 年，场外衍生品、雪球产品、量化交易等热点问题引发市场关注，上交所也针对这些热点问题进行了跟踪研究，并就其对场内期权市场的影响大小、传导路径、应对措施等进行了论证，防范风险的跨市场传导。





## 四、展望篇

上交所股票期权市场诞生近 7 年来，市场运行平稳、定价合理，投资者群体日渐成熟，受到了市场的广泛认可。目前上交所期权交易和持仓规模稳步增长，经济功能日益显现，已成为投资者的重要风险管理工具。

2022 年，我国资本市场发展将围绕“稳字当头、稳中求进”的主基调。为更好服务我国资本市场稳定健康发展，在此基础上进一步满足人民群众多样化的风险管理、资产配置、收益增强等投资需求，上交所将继续本着“期现联动发展，服务民富国强”的市场建设初心，秉持“四个敬畏、一个合力”的工作理念，积极研究推动期权产品新增标的、证券保证金机制、期权组合策略业务单边平仓功能及新增期权合约到期日数量等市场迫切需要的机制，更好地满足投资者的风险管理需求。

随着期权产品体系的逐步丰富，交易机制的日臻完善和投资者群体的理念优化，上交所股票期权市场必将为维护资本市场稳定发展、促进股票市场与实体经济良性联动发展做出更大贡献。



## 附录

附表1 2021年上证50ETF期权市场概览

		2021			2020		
		认购	认沽	合计	认购	认沽	合计
合约成交量 (万张)	总成交	34617.55	28316.68	62934.23	28919.19	22930.91	51850.10
	日均成交	142.46	116.53	258.99	119.01	94.37	213.37
	最高成交	0.00	0.00	556.90	0.00	0.00	510.12
	最低成交	0.00	0.00	119.56	0.00	0.00	96.53
合约成交面值 (亿元)	总成交	122254.24	96464.58	218718.82	92986.96	69998.52	162985.48
	日均成交	503.10	396.97	900.08	382.66	288.06	670.72
	最高成交	0.00	0.00	1988.30	0.00	0.00	1656.38
	最低成交	0.00	0.00	385.01	0.00	0.00	266.76
合约权利金 (亿元)	总成交	2070.90	1804.74	3875.64	1797.10	1390.38	3187.49
	日均成交	8.52	7.43	15.95	7.40	5.72	13.12
	最高成交	0.00	0.00	36.12	0.00	0.00	58.01
	最低成交	0.00	0.00	6.25	0.00	0.00	4.51
合约持仓量 (万张)	期末持仓	179.16	122.90	302.07	129.55	115.87	245.42
	日均持仓	174.16	130.94	305.10	151.52	127.29	278.81
	最高持仓	0.00	0.00	411.61	0.00	0.00	412.46
	最低持仓	0.00	0.00	215.53	0.00	0.00	179.46
合约行权	行权量 (万张)	25.96	32.72	58.68	25.25	20.75	46.00
	行权比例	95.08%	96.95%	96.11%	92.53%	94.05%	93.21%

(注：行权量和行权比例均为实值合约数据)

附表2 2021年上交所沪深300ETF期权市场概览

		2021			2020		
		认购	认沽	合计	认购	认沽	合计
合约成交量 (万张)	总成交	24512.05	22292.87	46804.92	24919.21	21479.87	46399.09
	日均成交	100.87	91.74	192.61	102.55	88.39	190.94
	最高成交	0.00	0.00	414.14	0.00	0.00	429.81
	最低成交	0.00	0.00	81.67	0.00	0.00	85.42
合约成交面值 (亿元)	总成交	129004.77	112595.45	241600.22	113127.31	92137.45	205264.76
	日均成交	530.88	463.36	994.24	465.54	379.17	844.71
	最高成交	0.00	0.00	2140.44	0.00	0.00	2023.17
	最低成交	0.00	0.00	409.67	0.00	0.00	337.91
合约权利金 (亿元)	总成交	2310.08	2047.56	4357.64	2258.08	1721.51	3979.59
	日均成交	9.51	8.43	17.93	9.29	7.08	16.38
	最高成交	0.00	0.00	46.89	0.00	0.00	55.02
	最低成交	0.00	0.00	6.66	0.00	0.00	5.61
合约持仓量 (万张)	期末持仓	94.85	87.60	182.44	79.96	82.17	162.12
	日均持仓	100.02	95.31	195.32	93.37	93.05	186.42
	最高持仓	0.00	0.00	244.20	0.00	0.00	221.91
	最低持仓	0.00	0.00	136.98	0.00	0.00	86.93
合约行权	行权量 (万张)	17.07	21.30	38.37	19.10	16.00	35.09
	行权比例	95.87%	96.64%	96.29%	87.83%	96.92%	91.75%

附表3 2021年上证50ETF期权合约概况

序号	合约简称	上市日	到期日	成交量 (张)	权利金 成交额 (百万元)	成交 面额 (亿元)
1	50ETF 购 3 月 2908A	20200723	20210324	6480	49.81	1.91
2	50ETF 购 3 月 2957A	20200723	20210324	5257	37.94	1.58
3	50ETF 购 3 月 3056A	20200723	20210324	10738	72.65	3.33
4	50ETF 购 3 月 3154A	20200723	20210324	8583	50.67	2.75
5	50ETF 购 3 月 3253A	20200723	20210324	13552	64.62	4.47
6	50ETF 购 3 月 3351A	20200723	20210324	49346	155.04	16.78
7	50ETF 购 3 月 3450A	20200723	20210324	393643	447.01	137.78
8	50ETF 购 3 月 3549A	20200723	20210324	1149762	779.71	413.97
9	50ETF 购 3 月 3647A	20200723	20210324	829623	566.79	306.95
10	50ETF 沽 3 月 2908A	20200723	20210324	94218	2.43	27.80
11	50ETF 沽 3 月 2957A	20200723	20210324	67417	2.15	20.22
12	50ETF 沽 3 月 3056A	20200723	20210324	57364	2.07	17.78
13	50ETF 沽 3 月 3154A	20200723	20210324	70618	3.72	22.60
14	50ETF 沽 3 月 3253A	20200723	20210324	103782	8.77	34.25
15	50ETF 沽 3 月 3351A	20200723	20210324	256143	30.16	87.08
16	50ETF 沽 3 月 3450A	20200723	20210324	988920	162.02	346.12
17	50ETF 沽 3 月 3549A	20200723	20210324	1494881	675.83	538.23
18	50ETF 沽 3 月 3647A	20200723	20210324	1239122	1038.43	458.46
19	50ETF 购 3 月 2859A	20200727	20210324	11201	93.78	3.25
20	50ETF 沽 3 月 2859A	20200727	20210324	106636	2.29	30.93
21	50ETF 购 3 月 3746A	20200805	20210324	883976	678.55	335.94
22	50ETF 沽 3 月 3746A	20200805	20210324	819242	848.84	311.34
23	50ETF 购 6 月 2957A	20201029	20210623	7153	43.92	2.15
24	50ETF 购 6 月 3056A	20201029	20210623	4023	23.56	1.25
25	50ETF 购 6 月 3154A	20201029	20210623	7996	33.49	2.56
26	50ETF 购 6 月 3253A	20201029	20210623	14588	43.79	4.81
27	50ETF 购 6 月 3351A	20201029	20210623	103542	186.55	35.20
28	50ETF 购 6 月 3450A	20201029	20210623	927843	601.42	324.75
29	50ETF 购 6 月 3549A	20201029	20210623	981361	643.68	353.34
30	50ETF 购 6 月 3647A	20201029	20210623	1204722	621.39	445.73
31	50ETF 购 6 月 3746A	20201029	20210623	750098	338.25	285.06
32	50ETF 沽 6 月 2957A	20201029	20210623	217589	22.96	65.27
33	50ETF 沽 6 月 3056A	20201029	20210623	202250	30.86	62.70
34	50ETF 沽 6 月 3154A	20201029	20210623	135822	29.10	43.46
35	50ETF 沽 6 月 3253A	20201029	20210623	190159	57.63	62.76
36	50ETF 沽 6 月 3351A	20201029	20210623	350945	94.83	119.31
37	50ETF 沽 6 月 3450A	20201029	20210623	1130060	321.06	395.52

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

38	50ETF 沽 6 月 3549A	20201029	20210623	1047761	621.44	377.24
39	50ETF 沽 6 月 3647A	20201029	20210623	721898	727.04	267.09
40	50ETF 沽 6 月 3746A	20201029	20210623	196247	361.93	74.58
41	50ETF 购 6 月 2908A	20201102	20210623	16061	106.08	4.74
42	50ETF 沽 6 月 2908A	20201102	20210623	333365	30.84	98.35
43	50ETF 购 3 月 3844A	20201110	20210324	785140	551.55	306.18
44	50ETF 沽 3 月 3844A	20201110	20210324	510832	691.37	199.21
45	50ETF 购 6 月 3844A	20201110	20210623	510546	250.03	199.10
46	50ETF 沽 6 月 3844A	20201110	20210623	89045	212.26	34.73
47	50ETF 购 1 月 3056A	20201126	20210127	6359	48.49	1.97
48	50ETF 购 1 月 3154A	20201126	20210127	3702	23.89	1.18
49	50ETF 购 1 月 3253A	20201126	20210127	6832	35.62	2.25
50	50ETF 购 1 月 3351A	20201126	20210127	19130	79.23	6.50
51	50ETF 购 1 月 3450A	20201126	20210127	79149	225.84	27.70
52	50ETF 购 1 月 3549A	20201126	20210127	244600	458.83	88.07
53	50ETF 购 1 月 3647A	20201126	20210127	674168	882.18	249.43
54	50ETF 购 1 月 3746A	20201126	20210127	1375098	1273.40	522.58
55	50ETF 购 1 月 3844A	20201126	20210127	2587204	1129.52	1008.94
56	50ETF 沽 1 月 3056A	20201126	20210127	14909	0.11	4.62
57	50ETF 沽 1 月 3154A	20201126	20210127	25531	0.26	8.17
58	50ETF 沽 1 月 3253A	20201126	20210127	33315	0.54	10.99
59	50ETF 沽 1 月 3351A	20201126	20210127	61044	2.00	20.75
60	50ETF 沽 1 月 3450A	20201126	20210127	195780	15.03	68.52
61	50ETF 沽 1 月 3549A	20201126	20210127	347045	64.54	124.95
62	50ETF 沽 1 月 3647A	20201126	20210127	498460	178.73	184.42
63	50ETF 沽 1 月 3746A	20201126	20210127	892115	308.31	339.03
64	50ETF 沽 1 月 3844A	20201126	20210127	1162662	640.37	453.41
65	50ETF 购 1 月 3100	20201130	20210127	12419	79.78	3.85
66	50ETF 购 1 月 3200	20201130	20210127	20529	111.63	6.57
67	50ETF 购 1 月 3300	20201130	20210127	50966	231.66	16.82
68	50ETF 购 1 月 3400	20201130	20210127	197811	666.78	67.26
69	50ETF 购 1 月 3500	20201130	20210127	706532	1683.69	247.29
70	50ETF 购 1 月 3600	20201130	20210127	1576041	2466.76	567.37
71	50ETF 购 1 月 3700	20201130	20210127	3351216	3715.02	1239.95
72	50ETF 购 1 月 3800	20201130	20210127	7280796	4499.28	2766.70
73	50ETF 购 1 月 3900	20201130	20210127	5090502	1691.01	1985.30
74	50ETF 沽 1 月 3100	20201130	20210127	36047	0.30	11.17
75	50ETF 沽 1 月 3200	20201130	20210127	70732	0.84	22.63
76	50ETF 沽 1 月 3300	20201130	20210127	142876	3.09	47.15
77	50ETF 沽 1 月 3400	20201130	20210127	385204	19.02	130.97
78	50ETF 沽 1 月 3500	20201130	20210127	1050170	125.02	367.56
79	50ETF 沽 1 月 3600	20201130	20210127	1667616	449.00	600.34
80	50ETF 沽 1 月 3700	20201130	20210127	2624912	927.12	971.22

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

81	50ETF 沽 1 月 3800	20201130	20210127	4219771	1763.67	1603.51
82	50ETF 沽 1 月 3900	20201130	20210127	2243974	2074.08	875.15
83	50ETF 购 3 月 3100	20201130	20210324	22327	133.88	6.92
84	50ETF 购 3 月 3200	20201130	20210324	33150	140.56	10.61
85	50ETF 购 3 月 3300	20201130	20210324	129382	390.11	42.70
86	50ETF 购 3 月 3400	20201130	20210324	721472	1177.71	245.30
87	50ETF 购 3 月 3500	20201130	20210324	3267357	2847.53	1143.57
88	50ETF 购 3 月 3600	20201130	20210324	4902841	3074.12	1765.02
89	50ETF 购 3 月 3700	20201130	20210324	4124496	2830.12	1526.06
90	50ETF 购 3 月 3800	20201130	20210324	4654872	3110.43	1768.85
91	50ETF 购 3 月 3900	20201130	20210324	3635899	2117.96	1418.00
92	50ETF 沽 3 月 3100	20201130	20210324	122578	4.35	38.00
93	50ETF 沽 3 月 3200	20201130	20210324	268887	13.75	86.04
94	50ETF 沽 3 月 3300	20201130	20210324	617449	54.17	203.76
95	50ETF 沽 3 月 3400	20201130	20210324	1757667	240.58	597.61
96	50ETF 沽 3 月 3500	20201130	20210324	5082027	1480.46	1778.71
97	50ETF 沽 3 月 3600	20201130	20210324	5941544	3621.39	2138.96
98	50ETF 沽 3 月 3700	20201130	20210324	4649361	4280.85	1720.26
99	50ETF 沽 3 月 3800	20201130	20210324	3567891	4352.71	1355.80
100	50ETF 沽 3 月 3900	20201130	20210324	1948390	3056.79	759.87
101	50ETF 购 6 月 3100	20201130	20210623	37234	182.09	11.54
102	50ETF 购 6 月 3200	20201130	20210623	119969	412.42	38.39
103	50ETF 购 6 月 3300	20201130	20210623	316114	731.23	104.32
104	50ETF 购 6 月 3400	20201130	20210623	2312773	2888.42	786.34
105	50ETF 购 6 月 3500	20201130	20210623	5854092	4485.94	2048.93
106	50ETF 购 6 月 3600	20201130	20210623	8037061	4751.42	2893.34
107	50ETF 购 6 月 3700	20201130	20210623	6209256	2504.47	2297.42
108	50ETF 购 6 月 3800	20201130	20210623	3079679	1007.99	1170.28
109	50ETF 购 6 月 3900	20201130	20210623	1743092	603.42	679.81
110	50ETF 沽 6 月 3100	20201130	20210623	414293	66.67	128.43
111	50ETF 沽 6 月 3200	20201130	20210623	731970	156.16	234.23
112	50ETF 沽 6 月 3300	20201130	20210623	1205032	343.88	397.66
113	50ETF 沽 6 月 3400	20201130	20210623	2878575	841.50	978.72
114	50ETF 沽 6 月 3500	20201130	20210623	5841341	2612.69	2044.47
115	50ETF 沽 6 月 3600	20201130	20210623	5961159	4535.22	2146.02
116	50ETF 沽 6 月 3700	20201130	20210623	2540877	3469.59	940.12
117	50ETF 沽 6 月 3800	20201130	20210623	809726	1710.39	307.70
118	50ETF 沽 6 月 3900	20201130	20210623	240558	712.15	93.82
119	50ETF 购 1 月 4000	20201202	20210127	2704320	552.23	1081.73
120	50ETF 沽 1 月 4000	20201202	20210127	490037	862.72	196.01
121	50ETF 购 3 月 4000	20201202	20210324	2655886	1166.51	1062.35
122	50ETF 沽 3 月 4000	20201202	20210324	965865	2002.55	386.35
123	50ETF 购 6 月 4000	20201202	20210623	1280499	488.08	512.20



## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

124	50ETF 沽 6 月 4000	20201202	20210623	114176	407.01	45.67
125	50ETF 购 1 月 3000	20201214	20210127	10875	83.84	3.26
126	50ETF 沽 1 月 3000	20201214	20210127	38783	0.18	11.63
127	50ETF 购 3 月 3000	20201214	20210324	8735	59.28	2.62
128	50ETF 沽 3 月 3000	20201214	20210324	106504	2.66	31.95
129	50ETF 购 6 月 3000	20201214	20210623	41422	253.65	12.43
130	50ETF 沽 6 月 3000	20201214	20210623	348748	37.95	104.62
131	50ETF 购 2 月 3100	20201224	20210224	22710	172.16	7.04
132	50ETF 购 2 月 3200	20201224	20210224	9340	62.36	2.99
133	50ETF 购 2 月 3300	20201224	20210224	29661	153.36	9.79
134	50ETF 购 2 月 3400	20201224	20210224	94755	373.44	32.22
135	50ETF 购 2 月 3500	20201224	20210224	286323	877.00	100.21
136	50ETF 购 2 月 3600	20201224	20210224	816200	1724.22	293.83
137	50ETF 购 2 月 3700	20201224	20210224	2453152	3469.90	907.67
138	50ETF 购 2 月 3800	20201224	20210224	5230314	4759.95	1987.52
139	50ETF 购 2 月 3900	20201224	20210224	5722196	3189.80	2231.66
140	50ETF 沽 2 月 3100	20201224	20210224	89521	1.93	27.75
141	50ETF 沽 2 月 3200	20201224	20210224	90022	3.19	28.81
142	50ETF 沽 2 月 3300	20201224	20210224	167300	9.48	55.21
143	50ETF 沽 2 月 3400	20201224	20210224	392541	34.44	133.46
144	50ETF 沽 2 月 3500	20201224	20210224	989338	142.56	346.27
145	50ETF 沽 2 月 3600	20201224	20210224	1805872	496.92	650.11
146	50ETF 沽 2 月 3700	20201224	20210224	3023663	1391.26	1118.76
147	50ETF 沽 2 月 3800	20201224	20210224	3941053	2487.27	1497.60
148	50ETF 沽 2 月 3900	20201224	20210224	3517804	2478.05	1371.94
149	50ETF 购 2 月 4000	20201231	20210224	4222270	1470.68	1688.91
150	50ETF 沽 2 月 4000	20201231	20210224	1994230	1800.81	797.69
151	50ETF 购 1 月 4100	20210106	20210127	1117102	145.34	458.01
152	50ETF 沽 1 月 4100	20210106	20210127	78926	214.09	32.36
153	50ETF 购 2 月 4100	20210106	20210224	2164589	425.48	887.48
154	50ETF 沽 2 月 4100	20210106	20210224	664873	1008.67	272.60
155	50ETF 购 3 月 4100	20210106	20210324	1434638	459.34	588.20
156	50ETF 沽 3 月 4100	20210106	20210324	330258	883.86	135.41
157	50ETF 购 6 月 4100	20210106	20210623	716790	269.60	293.88
158	50ETF 沽 6 月 4100	20210106	20210623	46883	217.57	19.22
159	50ETF 购 1 月 4200	20210108	20210127	674422	64.80	283.26
160	50ETF 沽 1 月 4200	20210108	20210127	17738	66.43	7.45
161	50ETF 购 2 月 4200	20210108	20210224	935790	117.43	393.03
162	50ETF 沽 2 月 4200	20210108	20210224	114228	281.34	47.98
163	50ETF 购 3 月 4200	20210108	20210324	929944	220.44	390.58
164	50ETF 沽 3 月 4200	20210108	20210324	85560	310.38	35.94
165	50ETF 购 6 月 4200	20210108	20210623	527065	198.92	221.37
166	50ETF 沽 6 月 4200	20210108	20210623	32052	188.71	13.46

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

167	50ETF 购 1 月 4300	20210113	20210127	200121	9.96	86.05
168	50ETF 沽 1 月 4300	20210113	20210127	8837	40.99	3.80
169	50ETF 购 2 月 4300	20210113	20210224	565718	47.24	243.26
170	50ETF 沽 2 月 4300	20210113	20210224	29092	117.51	12.51
171	50ETF 购 3 月 4300	20210113	20210324	684914	117.50	294.51
172	50ETF 沽 3 月 4300	20210113	20210324	20403	94.09	8.77
173	50ETF 购 6 月 4300	20210113	20210623	463048	149.17	199.11
174	50ETF 沽 6 月 4300	20210113	20210623	20561	156.89	8.84
175	50ETF 购 9 月 3400	20210128	20210922	3635664	867.28	1236.13
176	50ETF 购 9 月 3500	20210128	20210922	1822077	828.08	637.73
177	50ETF 购 9 月 3600	20210128	20210922	1122637	611.54	404.15
178	50ETF 购 9 月 3700	20210128	20210922	780258	469.40	288.70
179	50ETF 购 9 月 3800	20210128	20210922	631794	348.19	240.08
180	50ETF 购 9 月 3900	20210128	20210922	561879	251.86	219.13
181	50ETF 购 9 月 4000	20210128	20210922	526499	201.79	210.60
182	50ETF 购 9 月 4100	20210128	20210922	411018	124.89	168.52
183	50ETF 购 9 月 4200	20210128	20210922	450082	126.48	189.03
184	50ETF 沽 9 月 3400	20210128	20210922	1884127	2934.37	640.60
185	50ETF 沽 9 月 3500	20210128	20210922	775549	1480.81	271.44
186	50ETF 沽 9 月 3600	20210128	20210922	388568	936.76	139.88
187	50ETF 沽 9 月 3700	20210128	20210922	208280	615.00	77.06
188	50ETF 沽 9 月 3800	20210128	20210922	109219	390.49	41.50
189	50ETF 沽 9 月 3900	20210128	20210922	64477	265.24	25.15
190	50ETF 沽 9 月 4000	20210128	20210922	29355	136.34	11.74
191	50ETF 沽 9 月 4100	20210128	20210922	12814	73.93	5.25
192	50ETF 沽 9 月 4200	20210128	20210922	12263	82.64	5.15
193	50ETF 购 9 月 3300	20210129	20210922	8302337	2685.45	2739.77
194	50ETF 沽 9 月 3300	20210129	20210922	5449265	5232.33	1798.26
195	50ETF 购 9 月 4300	20210209	20210922	523180	115.19	224.97
196	50ETF 沽 9 月 4300	20210209	20210922	5013	45.41	2.16
197	50ETF 购 2 月 4400	20210218	20210224	45132	0.80	19.86
198	50ETF 沽 2 月 4400	20210218	20210224	6492	28.11	2.86
199	50ETF 购 3 月 4400	20210218	20210324	321749	21.94	141.57
200	50ETF 沽 3 月 4400	20210218	20210324	6767	39.96	2.98
201	50ETF 购 6 月 4400	20210218	20210623	377800	63.59	166.23
202	50ETF 沽 6 月 4400	20210218	20210623	18245	157.48	8.03
203	50ETF 购 9 月 4400	20210218	20210922	599998	111.39	264.00
204	50ETF 沽 9 月 4400	20210218	20210922	20332	190.31	8.95
205	50ETF 购 4 月 3400	20210225	20210428	4249582	4300.69	1444.86
206	50ETF 购 4 月 3500	20210225	20210428	9000031	4583.66	3150.01
207	50ETF 购 4 月 3600	20210225	20210428	5466661	1904.63	1968.00
208	50ETF 购 4 月 3700	20210225	20210428	2528725	693.56	935.63
209	50ETF 购 4 月 3800	20210225	20210428	1274090	328.08	484.15

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

210	50ETF 购 4 月 3900	20210225	20210428	593603	142.38	231.51
211	50ETF 购 4 月 4000	20210225	20210428	363844	73.44	145.54
212	50ETF 购 4 月 4100	20210225	20210428	220118	38.73	90.25
213	50ETF 购 4 月 4200	20210225	20210428	249754	28.77	104.90
214	50ETF 沽 4 月 3400	20210225	20210428	5325506	1482.13	1810.67
215	50ETF 沽 4 月 3500	20210225	20210428	8510194	4899.35	2978.57
216	50ETF 沽 4 月 3600	20210225	20210428	4061295	4863.07	1462.07
217	50ETF 沽 4 月 3700	20210225	20210428	1353442	2616.99	500.77
218	50ETF 沽 4 月 3800	20210225	20210428	427442	1092.37	162.43
219	50ETF 沽 4 月 3900	20210225	20210428	139914	454.40	54.57
220	50ETF 沽 4 月 4000	20210225	20210428	43420	186.85	17.37
221	50ETF 沽 4 月 4100	20210225	20210428	13154	68.80	5.39
222	50ETF 沽 4 月 4200	20210225	20210428	12945	82.82	5.44
223	50ETF 购 4 月 3300	20210301	20210428	1084176	2068.94	357.78
224	50ETF 沽 4 月 3300	20210301	20210428	1871810	310.25	617.70
225	50ETF 购 4 月 3200	20210309	20210428	162925	463.85	52.14
226	50ETF 沽 4 月 3200	20210309	20210428	688134	76.27	220.20
227	50ETF 购 9 月 3200	20210309	20210922	9469629	5329.83	3030.28
228	50ETF 沽 9 月 3200	20210309	20210922	9105829	4606.84	2913.87
229	50ETF 购 4 月 3100	20210310	20210428	65340	261.40	20.26
230	50ETF 沽 4 月 3100	20210310	20210428	366235	22.21	113.53
231	50ETF 购 9 月 3100	20210310	20210922	4157935	4734.14	1288.96
232	50ETF 沽 9 月 3100	20210310	20210922	6347307	1815.37	1967.67
233	50ETF 购 5 月 3100	20210325	20210526	37016	137.71	11.47
234	50ETF 购 5 月 3200	20210325	20210526	281809	721.29	90.18
235	50ETF 购 5 月 3300	20210325	20210526	1328815	2149.39	438.51
236	50ETF 购 5 月 3400	20210325	20210526	4394376	3933.09	1494.09
237	50ETF 购 5 月 3500	20210325	20210526	8410020	3793.18	2943.51
238	50ETF 购 5 月 3600	20210325	20210526	4750591	1125.52	1710.21
239	50ETF 购 5 月 3700	20210325	20210526	1630452	171.00	603.27
240	50ETF 购 5 月 3800	20210325	20210526	525728	40.66	199.78
241	50ETF 购 5 月 3900	20210325	20210526	199089	10.70	77.64
242	50ETF 沽 5 月 3100	20210325	20210526	242674	12.22	75.23
243	50ETF 沽 5 月 3200	20210325	20210526	699346	55.66	223.79
244	50ETF 沽 5 月 3300	20210325	20210526	1929019	316.00	636.58
245	50ETF 沽 5 月 3400	20210325	20210526	4648860	1598.23	1580.61
246	50ETF 沽 5 月 3500	20210325	20210526	6378394	3709.57	2232.44
247	50ETF 沽 5 月 3600	20210325	20210526	2605383	2857.87	937.94
248	50ETF 沽 5 月 3700	20210325	20210526	799239	1421.60	295.72
249	50ETF 沽 5 月 3800	20210325	20210526	91975	269.51	34.95
250	50ETF 沽 5 月 3900	20210325	20210526	27437	109.55	10.70
251	50ETF 购 5 月 4000	20210331	20210526	98725	2.50	39.49
252	50ETF 沽 5 月 4000	20210331	20210526	15096	74.84	6.04

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

253	50ETF 购 4 月 3000	20210416	20210428	5756	27.40	1.73
254	50ETF 沽 4 月 3000	20210416	20210428	4955	0.02	1.49
255	50ETF 购 5 月 3000	20210416	20210526	15260	73.51	4.58
256	50ETF 沽 5 月 3000	20210416	20210526	83878	0.93	25.16
257	50ETF 购 9 月 3000	20210416	20210922	1083948	2163.44	325.18
258	50ETF 沽 9 月 3000	20210416	20210922	2558813	379.19	767.64
259	50ETF 购 12 月 3061A	20210429	20211222	684126	1269.05	212.09
260	50ETF 购 12 月 3159A	20210429	20211222	2807034	2989.05	898.22
261	50ETF 购 12 月 3258A	20210429	20211222	5815530	3225.96	1919.13
262	50ETF 购 12 月 3357A	20210429	20211222	3724911	1415.53	1266.53
263	50ETF 购 12 月 3455A	20210429	20211222	2029688	646.73	710.35
264	50ETF 购 12 月 3554A	20210429	20211222	1400444	403.74	504.16
265	50ETF 购 12 月 3653A	20210429	20211222	893136	242.93	330.46
266	50ETF 购 12 月 3752A	20210429	20211222	694025	144.19	263.73
267	50ETF 购 12 月 3850A	20210429	20211222	670045	130.74	261.32
268	50ETF 沽 12 月 3061A	20210429	20211222	1909349	738.47	591.92
269	50ETF 沽 12 月 3159A	20210429	20211222	3272393	1689.01	1047.14
270	50ETF 沽 12 月 3258A	20210429	20211222	4246572	2793.06	1401.38
271	50ETF 沽 12 月 3357A	20210429	20211222	2016016	2040.94	685.49
272	50ETF 沽 12 月 3455A	20210429	20211222	537175	951.52	188.00
273	50ETF 沽 12 月 3554A	20210429	20211222	124293	357.17	44.74
274	50ETF 沽 12 月 3653A	20210429	20211222	49345	184.53	18.26
275	50ETF 沽 12 月 3752A	20210429	20211222	22721	101.94	8.63
276	50ETF 沽 12 月 3850A	20210429	20211222	9013	49.85	3.51
277	50ETF 购 12 月 2962A	20210507	20211222	240955	790.40	72.29
278	50ETF 沽 12 月 2962A	20210507	20211222	1264102	404.97	379.23
279	50ETF 购 12 月 3949A	20210526	20211222	667712	76.04	267.08
280	50ETF 沽 12 月 3949A	20210526	20211222	6819	44.45	2.73
281	50ETF 购 7 月 3200	20210527	20210728	1175870	1067.00	376.28
282	50ETF 购 7 月 3300	20210527	20210728	3249304	3310.70	1072.27
283	50ETF 购 7 月 3400	20210527	20210728	8561713	5011.30	2910.98
284	50ETF 购 7 月 3500	20210527	20210728	8541993	3371.80	2989.70
285	50ETF 购 7 月 3600	20210527	20210728	4518125	1371.09	1626.53
286	50ETF 购 7 月 3700	20210527	20210728	2196678	496.46	812.77
287	50ETF 购 7 月 3800	20210527	20210728	1129309	175.45	429.14
288	50ETF 购 7 月 3900	20210527	20210728	534875	66.22	208.60
289	50ETF 购 7 月 4000	20210527	20210728	319038	33.31	127.62
290	50ETF 沽 7 月 3200	20210527	20210728	1747379	230.34	559.16
291	50ETF 沽 7 月 3300	20210527	20210728	3905335	976.61	1288.76
292	50ETF 沽 7 月 3400	20210527	20210728	8195330	3529.87	2786.41
293	50ETF 沽 7 月 3500	20210527	20210728	6123687	5497.56	2143.29
294	50ETF 沽 7 月 3600	20210527	20210728	2362259	3703.72	850.41
295	50ETF 沽 7 月 3700	20210527	20210728	743230	1746.21	275.00

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

296	50ETF 沽 7 月 3800	20210527	20210728	136824	459.74	51.99
297	50ETF 沽 7 月 3900	20210527	20210728	43360	192.28	16.91
298	50ETF 沽 7 月 4000	20210527	20210728	27620	149.20	11.05
299	50ETF 购 7 月 4100	20210528	20210728	190529	10.68	78.12
300	50ETF 沽 7 月 4100	20210528	20210728	12373	83.91	5.07
301	50ETF 购 12 月 4048A	20210528	20211222	684669	64.51	280.71
302	50ETF 沽 12 月 4048A	20210528	20211222	9717	78.36	3.98
303	50ETF 购 7 月 3100	20210616	20210728	271701	366.00	84.23
304	50ETF 沽 7 月 3100	20210616	20210728	494502	17.25	153.30
305	50ETF 购 7 月 3000	20210622	20210728	33028	112.35	9.91
306	50ETF 沽 7 月 3000	20210622	20210728	139399	1.40	41.82
307	50ETF 购 8 月 3100	20210624	20210825	3160840	3376.21	979.86
308	50ETF 购 8 月 3200	20210624	20210825	8121636	4394.66	2598.92
309	50ETF 购 8 月 3300	20210624	20210825	7687903	2419.70	2537.01
310	50ETF 购 8 月 3400	20210624	20210825	4126869	1041.56	1403.14
311	50ETF 购 8 月 3500	20210624	20210825	2258209	578.44	790.37
312	50ETF 购 8 月 3600	20210624	20210825	1056252	185.24	380.25
313	50ETF 购 8 月 3700	20210624	20210825	480177	56.35	177.67
314	50ETF 购 8 月 3800	20210624	20210825	248179	22.77	94.31
315	50ETF 购 8 月 3900	20210624	20210825	149779	7.85	58.41
316	50ETF 沽 8 月 3100	20210624	20210825	4511598	812.05	1398.60
317	50ETF 沽 8 月 3200	20210624	20210825	8789149	3541.82	2812.53
318	50ETF 沽 8 月 3300	20210624	20210825	6357152	5279.92	2097.86
319	50ETF 沽 8 月 3400	20210624	20210825	2629233	3652.41	893.94
320	50ETF 沽 8 月 3500	20210624	20210825	870652	1600.95	304.73
321	50ETF 沽 8 月 3600	20210624	20210825	222103	617.24	79.96
322	50ETF 沽 8 月 3700	20210624	20210825	60082	235.68	22.23
323	50ETF 沽 8 月 3800	20210624	20210825	17360	81.13	6.60
324	50ETF 沽 8 月 3900	20210624	20210825	7286	43.98	2.84
325	50ETF 购 8 月 3000	20210705	20210825	601265	1218.88	180.38
326	50ETF 沽 8 月 3000	20210705	20210825	1375143	116.01	412.54
327	50ETF 购 7 月 2950	20210727	20210728	4243	9.54	1.25
328	50ETF 沽 7 月 2950	20210727	20210728	5732	0.02	1.69
329	50ETF 购 8 月 2950	20210727	20210825	56943	133.99	16.80
330	50ETF 沽 8 月 2950	20210727	20210825	429983	28.35	126.84
331	50ETF 购 9 月 2950	20210727	20210922	136893	312.12	40.38
332	50ETF 沽 9 月 2950	20210727	20210922	803813	80.87	237.12
333	50ETF 购 12 月 2912A	20210727	20211222	20167	63.87	5.95
334	50ETF 沽 12 月 2912A	20210727	20211222	750003	214.71	221.25
335	50ETF 购 7 月 2900	20210728	20210728	1032	2.81	0.30
336	50ETF 沽 7 月 2900	20210728	20210728	1081	0.00	0.31
337	50ETF 购 8 月 2900	20210728	20210825	33490	100.45	9.71
338	50ETF 沽 8 月 2900	20210728	20210825	304555	12.87	88.32

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

339	50ETF 购 9 月 2900	20210728	20210922	77309	230.83	22.42
340	50ETF 沽 9 月 2900	20210728	20210922	534461	38.79	154.99
341	50ETF 购 12 月 2863A	20210728	20211222	42729	152.13	12.39
342	50ETF 沽 12 月 2863A	20210728	20211222	908247	208.73	263.39
343	50ETF 购 3 月 2863A	20210729	20220323	17076	64.38	4.95
344	50ETF 购 3 月 2912A	20210729	20220323	5348	19.33	1.58
345	50ETF 购 3 月 2962A	20210729	20220323	37744	119.31	11.32
346	50ETF 购 3 月 3061A	20210729	20220323	47507	117.36	14.73
347	50ETF 购 3 月 3159A	20210729	20220323	154792	288.13	49.53
348	50ETF 购 3 月 3258A	20210729	20220323	355403	492.27	117.28
349	50ETF 购 3 月 3357A	20210729	20220323	383388	376.99	130.36
350	50ETF 购 3 月 3455A	20210729	20220323	403011	280.40	141.05
351	50ETF 购 3 月 3554A	20210729	20220323	485060	231.45	174.62
352	50ETF 沽 3 月 2863A	20210729	20220323	677995	156.80	196.62
353	50ETF 沽 3 月 2912A	20210729	20220323	610313	148.05	180.02
354	50ETF 沽 3 月 2962A	20210729	20220323	557862	209.95	167.36
355	50ETF 沽 3 月 3061A	20210729	20220323	429367	258.51	133.11
356	50ETF 沽 3 月 3159A	20210729	20220323	352862	332.23	112.91
357	50ETF 沽 3 月 3258A	20210729	20220323	349238	453.30	115.25
358	50ETF 沽 3 月 3357A	20210729	20220323	149291	261.83	50.76
359	50ETF 沽 3 月 3455A	20210729	20220323	49958	121.48	17.48
360	50ETF 沽 3 月 3554A	20210729	20220323	22621	83.62	8.14
361	50ETF 购 3 月 3653A	20210804	20220323	665589	215.48	246.27
362	50ETF 沽 3 月 3653A	20210804	20220323	16493	80.77	6.10
363	50ETF 购 8 月 2850	20210823	20210825	2507	8.03	0.71
364	50ETF 沽 8 月 2850	20210823	20210825	3852	0.01	1.10
365	50ETF 购 9 月 2850	20210823	20210922	18464	61.76	5.26
366	50ETF 沽 9 月 2850	20210823	20210922	212466	6.25	60.55
367	50ETF 购 12 月 2814A	20210823	20211222	14472	62.43	4.12
368	50ETF 沽 12 月 2814A	20210823	20211222	686860	96.58	195.76
369	50ETF 购 3 月 2814A	20210823	20220323	17789	77.19	5.07
370	50ETF 沽 3 月 2814A	20210823	20220323	884912	150.87	252.21
371	50ETF 购 10 月 2900	20210826	20211027	35892	124.29	10.41
372	50ETF 购 10 月 2950	20210826	20211027	43439	130.17	12.81
373	50ETF 购 10 月 3000	20210826	20211027	365405	902.67	109.62
374	50ETF 购 10 月 3100	20210826	20211027	1550118	2561.75	480.54
375	50ETF 购 10 月 3200	20210826	20211027	5346289	5301.79	1710.81
376	50ETF 购 10 月 3300	20210826	20211027	9268838	4257.45	3058.72
377	50ETF 购 10 月 3400	20210826	20211027	4166490	669.87	1416.61
378	50ETF 购 10 月 3500	20210826	20211027	1165472	89.55	407.92
379	50ETF 购 10 月 3600	20210826	20211027	400044	21.26	144.02
380	50ETF 沽 10 月 2900	20210826	20211027	386543	28.96	112.10
381	50ETF 沽 10 月 2950	20210826	20211027	453451	50.23	133.77

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

382	50ETF 沽 10 月 3000	20210826	20211027	1011865	153.73	303.56
383	50ETF 沽 10 月 3100	20210826	20211027	2644344	786.60	819.75
384	50ETF 沽 10 月 3200	20210826	20211027	5477736	2310.35	1752.88
385	50ETF 沽 10 月 3300	20210826	20211027	6662493	3320.90	2198.62
386	50ETF 沽 10 月 3400	20210826	20211027	2568031	2754.88	873.13
387	50ETF 沽 10 月 3500	20210826	20211027	286960	577.76	100.44
388	50ETF 沽 10 月 3600	20210826	20211027	45013	148.32	16.20
389	50ETF 购 10 月 2850	20210827	20211027	16970	67.44	4.84
390	50ETF 沽 10 月 2850	20210827	20211027	285584	14.96	81.39
391	50ETF 购 10 月 3700	20210908	20211027	153009	4.65	56.61
392	50ETF 沽 10 月 3700	20210908	20211027	19558	86.40	7.24
393	50ETF 购 11 月 2900	20210923	20211124	27823	101.60	8.07
394	50ETF 购 11 月 2950	20210923	20211124	25551	81.67	7.54
395	50ETF 购 11 月 3000	20210923	20211124	133935	350.80	40.18
396	50ETF 购 11 月 3100	20210923	20211124	1151227	1844.13	356.88
397	50ETF 购 11 月 3200	20210923	20211124	5245717	4082.81	1678.63
398	50ETF 购 11 月 3300	20210923	20211124	8309784	3228.26	2742.23
399	50ETF 购 11 月 3400	20210923	20211124	3755173	931.16	1276.76
400	50ETF 购 11 月 3500	20210923	20211124	1242434	155.62	434.85
401	50ETF 购 11 月 3600	20210923	20211124	515293	31.74	185.51
402	50ETF 沽 11 月 2900	20210923	20211124	156263	6.82	45.32
403	50ETF 沽 11 月 2950	20210923	20211124	169557	8.62	50.02
404	50ETF 沽 11 月 3000	20210923	20211124	542283	34.26	162.68
405	50ETF 沽 11 月 3100	20210923	20211124	1748040	211.61	541.89
406	50ETF 沽 11 月 3200	20210923	20211124	5362081	1465.90	1715.87
407	50ETF 沽 11 月 3300	20210923	20211124	6377256	4326.41	2104.49
408	50ETF 沽 11 月 3400	20210923	20211124	2023567	2822.56	688.01
409	50ETF 沽 11 月 3500	20210923	20211124	355939	796.87	124.58
410	50ETF 沽 11 月 3600	20210923	20211124	47377	150.43	17.06
411	50ETF 购 11 月 3700	20211011	20211124	148213	3.72	54.84
412	50ETF 沽 11 月 3700	20211011	20211124	14992	63.53	5.55
413	50ETF 购 10 月 3800	20211025	20211027	160	0.00	0.06
414	50ETF 沽 10 月 3800	20211025	20211027	701	3.40	0.27
415	50ETF 购 11 月 3800	20211025	20211124	19400	0.14	7.37
416	50ETF 沽 11 月 3800	20211025	20211124	4752	24.50	1.81
417	50ETF 购 3 月 3752A	20211025	20220323	796825	131.19	302.81
418	50ETF 沽 3 月 3752A	20211025	20220323	3767	17.36	1.43
419	50ETF 购 6 月 2912A	20211028	20220622	2098	8.60	0.62
420	50ETF 购 6 月 2962A	20211028	20220622	7013	25.64	2.10
421	50ETF 购 6 月 3061A	20211028	20220622	3900	11.72	1.21
422	50ETF 购 6 月 3159A	20211028	20220622	17037	40.25	5.45
423	50ETF 购 6 月 3258A	20211028	20220622	30524	58.90	10.07
424	50ETF 购 6 月 3357A	20211028	20220622	16776	25.15	5.70

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

425	50ETF 购 6 月 3455A	20211028	20220622	31144	35.03	10.90
426	50ETF 购 6 月 3554A	20211028	20220622	35737	29.55	12.87
427	50ETF 购 6 月 3653A	20211028	20220622	78638	49.79	29.10
428	50ETF 沽 6 月 2912A	20211028	20220622	58647	31.32	17.30
429	50ETF 沽 6 月 2962A	20211028	20220622	53245	33.17	15.97
430	50ETF 沽 6 月 3061A	20211028	20220622	51344	44.82	15.92
431	50ETF 沽 6 月 3159A	20211028	20220622	35498	37.94	11.36
432	50ETF 沽 6 月 3258A	20211028	20220622	40730	63.60	13.44
433	50ETF 沽 6 月 3357A	20211028	20220622	11260	22.74	3.83
434	50ETF 沽 6 月 3455A	20211028	20220622	3703	10.45	1.30
435	50ETF 沽 6 月 3554A	20211028	20220622	4979	17.07	1.79
436	50ETF 沽 6 月 3653A	20211028	20220622	6986	28.52	2.58
437	50ETF 购 6 月 2863A	20211104	20220622	5747	24.99	1.67
438	50ETF 沽 6 月 2863A	20211104	20220622	53585	18.61	15.54
439	50ETF 购 1 月 2912A	20211125	20220126	2138	7.86	0.63
440	50ETF 购 1 月 2962A	20211125	20220126	4928	15.23	1.48
441	50ETF 购 1 月 3061A	20211125	20220126	26075	58.23	8.08
442	50ETF 购 1 月 3159A	20211125	20220126	125385	168.90	40.12
443	50ETF 购 1 月 3258A	20211125	20220126	799181	589.37	263.73
444	50ETF 购 1 月 3357A	20211125	20220126	565085	232.25	192.15
445	50ETF 购 1 月 3455A	20211125	20220126	301831	71.88	105.63
446	50ETF 购 1 月 3554A	20211125	20220126	177618	24.35	63.94
447	50ETF 购 1 月 3653A	20211125	20220126	77656	7.21	28.73
448	50ETF 沽 1 月 2912A	20211125	20220126	56841	2.72	16.77
449	50ETF 沽 1 月 2962A	20211125	20220126	87888	6.75	26.37
450	50ETF 沽 1 月 3061A	20211125	20220126	186640	26.35	57.87
451	50ETF 沽 1 月 3159A	20211125	20220126	431238	116.01	137.99
452	50ETF 沽 1 月 3258A	20211125	20220126	787979	405.72	260.04
453	50ETF 沽 1 月 3357A	20211125	20220126	400322	413.57	136.12
454	50ETF 沽 1 月 3455A	20211125	20220126	54338	93.47	19.02
455	50ETF 沽 1 月 3554A	20211125	20220126	7464	18.84	2.69
456	50ETF 沽 1 月 3653A	20211125	20220126	2681	9.50	0.99
457	50ETF 购 12 月 2900	20211129	20211222	5905	21.81	1.71
458	50ETF 购 12 月 2950	20211129	20211222	11074	34.39	3.27
459	50ETF 购 12 月 3000	20211129	20211222	83985	210.28	25.20
460	50ETF 购 12 月 3100	20211129	20211222	712057	1055.29	220.74
461	50ETF 购 12 月 3200	20211129	20211222	2549762	1993.22	815.92
462	50ETF 购 12 月 3300	20211129	20211222	3568116	1407.47	1177.48
463	50ETF 购 12 月 3400	20211129	20211222	2076038	448.84	705.85
464	50ETF 购 12 月 3500	20211129	20211222	735519	68.85	257.43
465	50ETF 购 12 月 3600	20211129	20211222	268296	12.31	96.59
466	50ETF 沽 12 月 2900	20211129	20211222	21493	0.28	6.23
467	50ETF 沽 12 月 2950	20211129	20211222	37727	0.91	11.13



## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

468	50ETF 沽 12 月 3000	20211129	20211222	158273	6.11	47.48
469	50ETF 沽 12 月 3100	20211129	20211222	668238	73.67	207.15
470	50ETF 沽 12 月 3200	20211129	20211222	2145482	524.75	686.55
471	50ETF 沽 12 月 3300	20211129	20211222	3214404	1268.39	1060.75
472	50ETF 沽 12 月 3400	20211129	20211222	1683020	1422.73	572.23
473	50ETF 沽 12 月 3500	20211129	20211222	242773	383.70	84.97
474	50ETF 沽 12 月 3600	20211129	20211222	27559	69.19	9.92
475	50ETF 购 1 月 2900	20211129	20220126	7874	30.01	2.28
476	50ETF 购 1 月 2950	20211129	20220126	5704	18.81	1.68
477	50ETF 购 1 月 3000	20211129	20220126	28564	81.97	8.57
478	50ETF 购 1 月 3100	20211129	20220126	272706	516.51	84.54
479	50ETF 购 1 月 3200	20211129	20220126	1153530	1278.56	369.13
480	50ETF 购 1 月 3300	20211129	20220126	2613561	1459.84	862.48
481	50ETF 购 1 月 3400	20211129	20220126	1741836	560.85	592.22
482	50ETF 购 1 月 3500	20211129	20220126	739681	159.48	258.89
483	50ETF 购 1 月 3600	20211129	20220126	335919	40.70	120.93
484	50ETF 沽 1 月 2900	20211129	20220126	78941	2.37	22.89
485	50ETF 沽 1 月 2950	20211129	20220126	96678	4.66	28.52
486	50ETF 沽 1 月 3000	20211129	20220126	231145	16.92	69.34
487	50ETF 沽 1 月 3100	20211129	20220126	593320	82.71	183.93
488	50ETF 沽 1 月 3200	20211129	20220126	1500569	446.69	480.18
489	50ETF 沽 1 月 3300	20211129	20220126	1941457	1303.26	640.68
490	50ETF 沽 1 月 3400	20211129	20220126	833703	1098.65	283.46
491	50ETF 沽 1 月 3500	20211129	20220126	112029	227.95	39.21
492	50ETF 沽 1 月 3600	20211129	20220126	19068	56.76	6.86
493	50ETF 购 3 月 2900	20211129	20220323	2120	8.84	0.61
494	50ETF 购 3 月 2950	20211129	20220323	6452	20.61	1.90
495	50ETF 购 3 月 3000	20211129	20220323	5001	15.91	1.50
496	50ETF 购 3 月 3100	20211129	20220323	11707	26.34	3.63
497	50ETF 购 3 月 3200	20211129	20220323	54941	88.50	17.58
498	50ETF 购 3 月 3300	20211129	20220323	195684	235.18	64.58
499	50ETF 购 3 月 3400	20211129	20220323	218776	185.74	74.38
500	50ETF 购 3 月 3500	20211129	20220323	210201	113.65	73.57
501	50ETF 购 3 月 3600	20211129	20220323	285336	93.03	102.72
502	50ETF 沽 3 月 2900	20211129	20220323	366533	40.28	106.29
503	50ETF 沽 3 月 2950	20211129	20220323	306227	45.93	90.34
504	50ETF 沽 3 月 3000	20211129	20220323	194518	42.11	58.36
505	50ETF 沽 3 月 3100	20211129	20220323	194208	74.64	60.20
506	50ETF 沽 3 月 3200	20211129	20220323	225505	151.65	72.16
507	50ETF 沽 3 月 3300	20211129	20220323	198685	212.18	65.57
508	50ETF 沽 3 月 3400	20211129	20220323	70464	107.65	23.96
509	50ETF 沽 3 月 3500	20211129	20220323	13450	28.69	4.71
510	50ETF 沽 3 月 3600	20211129	20220323	2071	6.32	0.75

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

511	50ETF 购 6 月 2900	20211129	20220622	8501	39.44	2.47
512	50ETF 购 6 月 2950	20211129	20220622	337	1.41	0.10
513	50ETF 购 6 月 3000	20211129	20220622	953	3.53	0.29
514	50ETF 购 6 月 3100	20211129	20220622	1686	4.94	0.52
515	50ETF 购 6 月 3200	20211129	20220622	11971	27.23	3.83
516	50ETF 购 6 月 3300	20211129	20220622	30705	56.57	10.13
517	50ETF 购 6 月 3400	20211129	20220622	23361	34.08	7.94
518	50ETF 购 6 月 3500	20211129	20220622	24354	25.04	8.52
519	50ETF 购 6 月 3600	20211129	20220622	39878	29.76	14.36
520	50ETF 沽 6 月 2900	20211129	20220622	46639	13.40	13.53
521	50ETF 沽 6 月 2950	20211129	20220622	25006	9.16	7.38
522	50ETF 沽 6 月 3000	20211129	20220622	26319	12.37	7.90
523	50ETF 沽 6 月 3100	20211129	20220622	38258	28.18	11.86
524	50ETF 沽 6 月 3200	20211129	20220622	30777	31.70	9.85
525	50ETF 沽 6 月 3300	20211129	20220622	41476	61.62	13.69
526	50ETF 沽 6 月 3400	20211129	20220622	17850	35.32	6.07
527	50ETF 沽 6 月 3500	20211129	20220622	7311	18.90	2.56
528	50ETF 沽 6 月 3600	20211129	20220622	2592	8.76	0.93
529	50ETF 购 12 月 3700	20211208	20211222	51423	1.20	19.03
530	50ETF 沽 12 月 3700	20211208	20211222	3328	11.95	1.23
531	50ETF 购 1 月 3700	20211208	20220126	171777	13.78	63.56
532	50ETF 沽 1 月 3700	20211208	20220126	4216	16.65	1.56
533	50ETF 购 3 月 3700	20211208	20220323	183593	42.68	67.93
534	50ETF 沽 3 月 3700	20211208	20220323	1335	5.09	0.49
535	50ETF 购 6 月 3700	20211208	20220622	37092	22.37	13.72
536	50ETF 沽 6 月 3700	20211208	20220622	4420	17.71	1.64
537	50ETF 购 12 月 3800	20211210	20211222	8487	0.08	3.23
538	50ETF 沽 12 月 3800	20211210	20211222	977	4.46	0.37
539	50ETF 购 1 月 3800	20211210	20220126	94289	4.15	35.83
540	50ETF 沽 1 月 3800	20211210	20220126	1605	7.85	0.61
541	50ETF 购 3 月 3800	20211210	20220323	297751	37.82	113.15
542	50ETF 沽 3 月 3800	20211210	20220323	201	0.96	0.08
543	50ETF 购 6 月 3800	20211210	20220622	35379	14.74	13.44
544	50ETF 沽 6 月 3800	20211210	20220622	3107	15.12	1.18
545	50ETF 购 2 月 2900	20211223	20220223	257	1.01	0.07
546	50ETF 购 2 月 2950	20211223	20220223	200	0.66	0.06
547	50ETF 购 2 月 3000	20211223	20220223	425	1.26	0.13
548	50ETF 购 2 月 3100	20211223	20220223	3642	7.49	1.13
549	50ETF 购 2 月 3200	20211223	20220223	23160	30.62	7.41
550	50ETF 购 2 月 3300	20211223	20220223	64629	49.57	21.33
551	50ETF 购 2 月 3400	20211223	20220223	62262	26.15	21.17
552	50ETF 购 2 月 3500	20211223	20220223	38333	8.18	13.42
553	50ETF 购 2 月 3600	20211223	20220223	29348	3.26	10.57

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

554	50ETF 沽 2 月 2900	20211223	20220223	6340	0.34	1.84
555	50ETF 沽 2 月 2950	20211223	20220223	10529	0.81	3.11
556	50ETF 沽 2 月 3000	20211223	20220223	22863	2.38	6.86
557	50ETF 沽 2 月 3100	20211223	20220223	47774	10.74	14.81
558	50ETF 沽 2 月 3200	20211223	20220223	66406	31.52	21.25
559	50ETF 沽 2 月 3300	20211223	20220223	55120	49.04	18.19
560	50ETF 沽 2 月 3400	20211223	20220223	13789	21.19	4.69
561	50ETF 沽 2 月 3500	20211223	20220223	3159	7.29	1.11
562	50ETF 沽 2 月 3600	20211223	20220223	636	2.04	0.23
563	50ETF 购 2 月 3700	20211224	20220223	10550	0.67	3.90
564	50ETF 沽 2 月 3700	20211224	20220223	68	0.28	0.03

附表4 2021年上交所沪深300ETF期权合约概况

序号	合约简称	上市日	到期日	成交量(张)	权利金 成交额 (百万元)	成交 面额 (亿元)
1	300ETF 购 3月 4343A	20200723	20210324	4156	41.06	1.83
2	300ETF 购 3月 4441A	20200723	20210324	5525	49.65	2.49
3	300ETF 购 3月 4540A	20200723	20210324	7493	60.30	3.45
4	300ETF 购 3月 4639A	20200723	20210324	9030	60.82	4.24
5	300ETF 购 3月 4737A	20200723	20210324	24685	118.64	11.85
6	300ETF 购 3月 4836A	20200723	20210324	92665	276.98	45.40
7	300ETF 购 3月 4935A	20200723	20210324	689855	1217.03	344.94
8	300ETF 购 3月 5182A	20200723	20210324	1814571	1706.13	952.72
9	300ETF 购 3月 5428A	20200723	20210324	1645614	1793.53	905.04
10	300ETF 沽 3月 4343A	20200723	20210324	96646	5.69	42.53
11	300ETF 沽 3月 4441A	20200723	20210324	108491	7.87	48.82
12	300ETF 沽 3月 4540A	20200723	20210324	140300	13.01	64.54
13	300ETF 沽 3月 4639A	20200723	20210324	171848	21.72	80.77
14	300ETF 沽 3月 4737A	20200723	20210324	287248	51.03	137.87
15	300ETF 沽 3月 4836A	20200723	20210324	532033	130.47	260.69
16	300ETF 沽 3月 4935A	20200723	20210324	1285561	432.88	642.80
17	300ETF 沽 3月 5182A	20200723	20210324	2211589	2648.50	1161.17
18	300ETF 沽 3月 5428A	20200723	20210324	1429794	2644.72	786.34
19	300ETF 购 3月 4145A	20200727	20210324	24997	279.04	10.50
20	300ETF 购 3月 4244A	20200727	20210324	6473	74.42	2.78
21	300ETF 沽 3月 4145A	20200727	20210324	126118	4.59	52.97
22	300ETF 沽 3月 4244A	20200727	20210324	115692	5.52	49.75
23	300ETF 购 3月 5675A	20200818	20210324	1369286	1081.58	787.33
24	300ETF 沽 3月 5675A	20200818	20210324	637968	1823.14	366.83
25	300ETF 购 6月 4343A	20201029	20210623	18878	176.91	8.31
26	300ETF 购 6月 4441A	20201029	20210623	5942	51.89	2.67
27	300ETF 购 6月 4540A	20201029	20210623	6023	42.42	2.77
28	300ETF 购 6月 4639A	20201029	20210623	14541	91.36	6.83
29	300ETF 购 6月 4737A	20201029	20210623	14873	80.98	7.14
30	300ETF 购 6月 4836A	20201029	20210623	38345	177.51	18.79
31	300ETF 购 6月 4935A	20201029	20210623	171515	568.57	85.76
32	300ETF 购 6月 5182A	20201029	20210623	1751934	1560.16	919.83
33	300ETF 购 6月 5428A	20201029	20210623	1696480	1293.30	933.01
34	300ETF 沽 6月 4343A	20201029	20210623	525817	132.75	231.37
35	300ETF 沽 6月 4441A	20201029	20210623	321457	109.66	144.64
36	300ETF 沽 6月 4540A	20201029	20210623	235992	101.39	108.55
37	300ETF 沽 6月 4639A	20201029	20210623	183056	99.01	86.04

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

38	300ETF 沽 6 月 4737A	20201029	20210623	207143	126.13	99.42
39	300ETF 沽 6 月 4836A	20201029	20210623	336374	263.55	164.82
40	300ETF 沽 6 月 4935A	20201029	20210623	453966	353.83	226.99
41	300ETF 沽 6 月 5182A	20201029	20210623	2063461	1687.71	1083.40
42	300ETF 沽 6 月 5428A	20201029	20210623	727422	1646.60	400.06
43	300ETF 购 6 月 5675A	20201105	20210623	618144	434.16	355.43
44	300ETF 沽 6 月 5675A	20201105	20210623	91177	382.61	52.43
45	300ETF 购 3 月 5922A	20201109	20210324	729543	383.12	437.74
46	300ETF 沽 3 月 5922A	20201109	20210324	132807	560.97	79.69
47	300ETF 购 6 月 5922A	20201109	20210623	408903	275.35	245.35
48	300ETF 沽 6 月 5922A	20201109	20210623	26004	161.04	15.60
49	300ETF 购 1 月 4540A	20201126	20210127	13186	120.02	6.07
50	300ETF 购 1 月 4639A	20201126	20210127	23448	187.47	11.02
51	300ETF 购 1 月 4737A	20201126	20210127	36322	243.55	17.43
52	300ETF 购 1 月 4836A	20201126	20210127	147963	810.91	72.50
53	300ETF 购 1 月 4935A	20201126	20210127	592825	2815.39	296.41
54	300ETF 购 1 月 5182A	20201126	20210127	2161173	5679.24	1134.62
55	300ETF 购 1 月 5428A	20201126	20210127	5747977	6872.33	3161.34
56	300ETF 购 1 月 5675A	20201126	20210127	4881783	1917.49	2807.01
57	300ETF 购 1 月 5922A	20201126	20210127	1529986	281.34	917.99
58	300ETF 沽 1 月 4540A	20201126	20210127	74908	1.21	34.46
59	300ETF 沽 1 月 4639A	20201126	20210127	89190	1.95	41.92
60	300ETF 沽 1 月 4737A	20201126	20210127	160597	5.05	77.09
61	300ETF 沽 1 月 4836A	20201126	20210127	266982	13.32	130.82
62	300ETF 沽 1 月 4935A	20201126	20210127	781516	67.89	390.76
63	300ETF 沽 1 月 5182A	20201126	20210127	2482043	764.59	1303.08
64	300ETF 沽 1 月 5428A	20201126	20210127	4172215	2933.32	2294.68
65	300ETF 沽 1 月 5675A	20201126	20210127	1828912	3649.66	1051.62
66	300ETF 沽 1 月 5922A	20201126	20210127	233495	1001.16	140.10
67	300ETF 购 1 月 6169A	20201202	20210127	456763	40.96	285.48
68	300ETF 沽 1 月 6169A	20201202	20210127	17462	119.04	10.91
69	300ETF 购 3 月 6169A	20201202	20210324	411319	129.61	257.09
70	300ETF 沽 3 月 6169A	20201202	20210324	19092	138.56	11.93
71	300ETF 购 6 月 6169A	20201202	20210623	296823	163.15	185.52
72	300ETF 沽 6 月 6169A	20201202	20210623	15200	128.34	9.50
73	300ETF 购 2 月 4540A	20201224	20210224	7225	71.82	3.32
74	300ETF 购 2 月 4639A	20201224	20210224	3314	28.85	1.56
75	300ETF 购 2 月 4737A	20201224	20210224	5889	45.94	2.83
76	300ETF 购 2 月 4836A	20201224	20210224	15877	97.29	7.78
77	300ETF 购 2 月 4935A	20201224	20210224	74926	388.21	37.46
78	300ETF 购 2 月 5182A	20201224	20210224	412923	1307.74	216.79
79	300ETF 购 2 月 5428A	20201224	20210224	1969470	3233.93	1083.16
80	300ETF 购 2 月 5675A	20201224	20210224	2764197	2049.93	1589.39

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

81	300ETF 购 2 月 5922A	20201224	20210224	1260902	419.47	756.56
82	300ETF 沽 2 月 4540A	20201224	20210224	85826	3.12	39.48
83	300ETF 沽 2 月 4639A	20201224	20210224	58122	3.48	27.32
84	300ETF 沽 2 月 4737A	20201224	20210224	112513	10.01	54.00
85	300ETF 沽 2 月 4836A	20201224	20210224	170231	21.37	83.41
86	300ETF 沽 2 月 4935A	20201224	20210224	484290	91.69	242.15
87	300ETF 沽 2 月 5182A	20201224	20210224	1009430	419.33	529.98
88	300ETF 沽 2 月 5428A	20201224	20210224	1726370	1654.39	949.45
89	300ETF 沽 2 月 5675A	20201224	20210224	1497558	2106.59	861.08
90	300ETF 沽 2 月 5922A	20201224	20210224	283121	650.30	169.88
91	300ETF 购 2 月 6169A	20201229	20210224	428888	73.60	268.07
92	300ETF 沽 2 月 6169A	20201229	20210224	10315	57.87	6.45
93	300ETF 购 1 月 6415A	20210106	20210127	242983	12.10	157.94
94	300ETF 沽 1 月 6415A	20210106	20210127	5093	47.29	3.31
95	300ETF 购 2 月 6415A	20210106	20210224	218448	25.63	141.99
96	300ETF 沽 2 月 6415A	20210106	20210224	3575	31.85	2.32
97	300ETF 购 3 月 6415A	20210106	20210324	226053	50.52	146.93
98	300ETF 沽 3 月 6415A	20210106	20210324	5008	54.02	3.26
99	300ETF 购 6 月 6415A	20210106	20210623	340291	156.80	221.18
100	300ETF 沽 6 月 6415A	20210106	20210623	8048	87.50	5.23
101	300ETF 购 1 月 6662A	20210113	20210127	39927	0.92	26.95
102	300ETF 沽 1 月 6662A	20210113	20210127	1724	19.94	1.16
103	300ETF 购 2 月 6662A	20210113	20210224	108669	6.04	73.35
104	300ETF 沽 2 月 6662A	20210113	20210224	2118	24.41	1.43
105	300ETF 购 3 月 6662A	20210113	20210324	143559	18.61	96.90
106	300ETF 沽 3 月 6662A	20210113	20210324	3671	47.23	2.48
107	300ETF 购 6 月 6662A	20210113	20210623	270355	81.61	182.49
108	300ETF 沽 6 月 6662A	20210113	20210623	4367	65.65	2.95
109	300ETF 购 1 月 4800	20210118	20210127	4551	32.45	2.18
110	300ETF 购 1 月 4900	20210118	20210127	10875	67.41	5.33
111	300ETF 购 1 月 5000	20210118	20210127	26197	132.72	13.10
112	300ETF 购 1 月 5250	20210118	20210127	364982	930.13	191.62
113	300ETF 购 1 月 5500	20210118	20210127	2620725	1599.75	1441.40
114	300ETF 购 1 月 5750	20210118	20210127	454483	37.03	261.33
115	300ETF 购 1 月 6000	20210118	20210127	35577	0.75	21.35
116	300ETF 购 1 月 6250	20210118	20210127	6033	0.04	3.77
117	300ETF 购 1 月 6500	20210118	20210127	1694	0.01	1.10
118	300ETF 沽 1 月 4800	20210118	20210127	2033	0.01	0.98
119	300ETF 沽 1 月 4900	20210118	20210127	5196	0.04	2.55
120	300ETF 沽 1 月 5000	20210118	20210127	13943	0.13	6.97
121	300ETF 沽 1 月 5250	20210118	20210127	251335	14.50	131.95
122	300ETF 沽 1 月 5500	20210118	20210127	2014092	846.10	1107.75
123	300ETF 沽 1 月 5750	20210118	20210127	298495	669.85	171.63

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

124	300ETF 沽 1 月 6000	20210118	20210127	12305	61.31	7.38
125	300ETF 沽 1 月 6250	20210118	20210127	4542	34.04	2.84
126	300ETF 沽 1 月 6500	20210118	20210127	2615	25.96	1.70
127	300ETF 购 2 月 4800	20210118	20210224	13866	98.41	6.66
128	300ETF 购 2 月 4900	20210118	20210224	21669	128.37	10.62
129	300ETF 购 2 月 5000	20210118	20210224	171724	832.12	85.86
130	300ETF 购 2 月 5250	20210118	20210224	1170097	3157.22	614.30
131	300ETF 购 2 月 5500	20210118	20210224	4581335	5551.44	2519.73
132	300ETF 购 2 月 5750	20210118	20210224	3647776	1886.34	2097.47
133	300ETF 购 2 月 6000	20210118	20210224	1158690	206.72	695.21
134	300ETF 购 2 月 6250	20210118	20210224	235209	18.30	147.01
135	300ETF 购 2 月 6500	20210118	20210224	87658	3.77	56.98
136	300ETF 沽 2 月 4800	20210118	20210224	77581	4.62	37.24
137	300ETF 沽 2 月 4900	20210118	20210224	157498	13.73	77.17
138	300ETF 沽 2 月 5000	20210118	20210224	643200	87.58	321.60
139	300ETF 沽 2 月 5250	20210118	20210224	2129302	909.72	1117.88
140	300ETF 沽 2 月 5500	20210118	20210224	3695735	3500.04	2032.65
141	300ETF 沽 2 月 5750	20210118	20210224	2043276	2771.02	1174.88
142	300ETF 沽 2 月 6000	20210118	20210224	301346	856.03	180.81
143	300ETF 沽 2 月 6250	20210118	20210224	20018	126.25	12.51
144	300ETF 沽 2 月 6500	20210118	20210224	7850	75.84	5.10
145	300ETF 购 3 月 4800	20210118	20210324	285942	830.51	137.25
146	300ETF 购 3 月 4900	20210118	20210324	1267856	2300.94	621.25
147	300ETF 购 3 月 5000	20210118	20210324	4180017	5130.81	2090.01
148	300ETF 购 3 月 5250	20210118	20210324	4096831	3818.88	2150.84
149	300ETF 购 3 月 5500	20210118	20210324	4158686	3586.77	2287.28
150	300ETF 购 3 月 5750	20210118	20210324	2550866	1603.31	1466.75
151	300ETF 购 3 月 6000	20210118	20210324	1291383	481.71	774.83
152	300ETF 购 3 月 6250	20210118	20210324	615532	132.69	384.71
153	300ETF 购 3 月 6500	20210118	20210324	204182	24.60	132.72
154	300ETF 沽 3 月 4800	20210118	20210324	834345	161.00	400.49
155	300ETF 沽 3 月 4900	20210118	20210324	2034199	561.64	996.76
156	300ETF 沽 3 月 5000	20210118	20210324	5987132	2738.85	2993.57
157	300ETF 沽 3 月 5250	20210118	20210324	4723978	6137.10	2480.09
158	300ETF 沽 3 月 5500	20210118	20210324	2883070	6257.41	1585.69
159	300ETF 沽 3 月 5750	20210118	20210324	1036932	3235.73	596.24
160	300ETF 沽 3 月 6000	20210118	20210324	198232	1022.64	118.94
161	300ETF 沽 3 月 6250	20210118	20210324	27537	233.73	17.21
162	300ETF 沽 3 月 6500	20210118	20210324	15581	185.80	10.13
163	300ETF 购 6 月 4800	20210118	20210623	86378	333.28	41.46
164	300ETF 购 6 月 4900	20210118	20210623	425251	1265.82	208.37
165	300ETF 购 6 月 5000	20210118	20210623	2919406	6131.33	1459.70
166	300ETF 购 6 月 5250	20210118	20210623	7440084	7000.98	3906.04

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

167	300ETF 购 6 月 5500	20210118	20210623	4532079	2047.18	2492.64
168	300ETF 购 6 月 5750	20210118	20210623	1444532	472.38	830.61
169	300ETF 购 6 月 6000	20210118	20210623	723111	246.61	433.87
170	300ETF 购 6 月 6250	20210118	20210623	396094	131.36	247.56
171	300ETF 购 6 月 6500	20210118	20210623	291621	78.61	189.55
172	300ETF 沽 6 月 4800	20210118	20210623	678512	352.21	325.69
173	300ETF 沽 6 月 4900	20210118	20210623	1045419	643.02	512.26
174	300ETF 沽 6 月 5000	20210118	20210623	3152996	1623.54	1576.50
175	300ETF 沽 6 月 5250	20210118	20210623	6197291	6111.95	3253.58
176	300ETF 沽 6 月 5500	20210118	20210623	1791176	4699.31	985.15
177	300ETF 沽 6 月 5750	20210118	20210623	159395	764.76	91.65
178	300ETF 沽 6 月 6000	20210118	20210623	35529	262.18	21.32
179	300ETF 沽 6 月 6250	20210118	20210623	13049	133.72	8.16
180	300ETF 沽 6 月 6500	20210118	20210623	9306	123.00	6.05
181	300ETF 购 1 月 6750	20210126	20210127	110	0.00	0.07
182	300ETF 沽 1 月 6750	20210126	20210127	168	2.09	0.11
183	300ETF 购 2 月 6750	20210126	20210224	35685	0.58	24.09
184	300ETF 沽 2 月 6750	20210126	20210224	3566	41.89	2.41
185	300ETF 购 3 月 6750	20210126	20210324	139694	10.06	94.29
186	300ETF 沽 3 月 6750	20210126	20210324	8656	132.88	5.84
187	300ETF 购 6 月 6750	20210126	20210623	301499	54.72	203.51
188	300ETF 沽 6 月 6750	20210126	20210623	11095	179.72	7.49
189	300ETF 购 9 月 4800	20210128	20210922	2239803	3498.08	1075.11
190	300ETF 购 9 月 4900	20210128	20210922	5281820	5107.03	2588.09
191	300ETF 购 9 月 5000	20210128	20210922	6679656	5118.91	3339.83
192	300ETF 购 9 月 5250	20210128	20210922	3352114	1606.69	1759.86
193	300ETF 购 9 月 5500	20210128	20210922	1231500	818.11	677.33
194	300ETF 购 9 月 5750	20210128	20210922	679584	380.24	390.76
195	300ETF 购 9 月 6000	20210128	20210922	586378	239.94	351.83
196	300ETF 购 9 月 6250	20210128	20210922	416732	107.73	260.46
197	300ETF 购 9 月 6500	20210128	20210922	402543	102.72	261.65
198	300ETF 沽 9 月 4800	20210128	20210922	3596649	1884.48	1726.39
199	300ETF 沽 9 月 4900	20210128	20210922	6137081	4225.04	3007.17
200	300ETF 沽 9 月 5000	20210128	20210922	5994333	5985.31	2997.17
201	300ETF 沽 9 月 5250	20210128	20210922	1729570	4645.31	908.02
202	300ETF 沽 9 月 5500	20210128	20210922	183889	871.71	101.14
203	300ETF 沽 9 月 5750	20210128	20210922	57570	381.86	33.10
204	300ETF 沽 9 月 6000	20210128	20210922	21489	192.24	12.89
205	300ETF 沽 9 月 6250	20210128	20210922	7354	85.15	4.60
206	300ETF 沽 9 月 6500	20210128	20210922	5072	69.76	3.30
207	300ETF 购 2 月 4700	20210201	20210224	2644	22.17	1.24
208	300ETF 沽 2 月 4700	20210201	20210224	22860	0.45	10.74
209	300ETF 购 3 月 4700	20210201	20210324	48758	206.61	22.92



## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

210	300ETF 沽 3 月 4700	20210201	20210324	432508	49.64	203.28
211	300ETF 购 6 月 4700	20210201	20210623	32333	157.43	15.20
212	300ETF 沽 6 月 4700	20210201	20210623	459843	202.30	216.13
213	300ETF 购 9 月 4700	20210201	20210922	690984	1671.05	324.76
214	300ETF 沽 9 月 4700	20210201	20210922	1868517	768.94	878.20
215	300ETF 购 9 月 6750	20210210	20210922	474181	83.01	320.07
216	300ETF 沽 9 月 6750	20210210	20210922	12383	204.00	8.36
217	300ETF 购 4 月 4800	20210225	20210428	1250493	2952.93	600.24
218	300ETF 购 4 月 4900	20210225	20210428	3505511	5571.10	1717.70
219	300ETF 购 4 月 5000	20210225	20210428	8305528	8703.40	4152.76
220	300ETF 购 4 月 5250	20210225	20210428	5024719	1761.08	2637.98
221	300ETF 购 4 月 5500	20210225	20210428	1291014	390.97	710.06
222	300ETF 购 4 月 5750	20210225	20210428	430694	112.23	247.65
223	300ETF 购 4 月 6000	20210225	20210428	204279	36.82	122.57
224	300ETF 购 4 月 6250	20210225	20210428	87347	7.31	54.59
225	300ETF 购 4 月 6500	20210225	20210428	70798	3.23	46.02
226	300ETF 沽 4 月 4800	20210225	20210428	1967820	772.52	944.55
227	300ETF 沽 4 月 4900	20210225	20210428	4128763	2208.98	2023.09
228	300ETF 沽 4 月 5000	20210225	20210428	7495581	5354.98	3747.79
229	300ETF 沽 4 月 5250	20210225	20210428	3461195	7508.53	1817.13
230	300ETF 沽 4 月 5500	20210225	20210428	640898	2792.83	352.49
231	300ETF 沽 4 月 5750	20210225	20210428	51728	311.52	29.74
232	300ETF 沽 4 月 6000	20210225	20210428	17655	163.15	10.59
233	300ETF 沽 4 月 6250	20210225	20210428	4798	56.52	3.00
234	300ETF 沽 4 月 6500	20210225	20210428	3696	53.26	2.40
235	300ETF 购 4 月 4700	20210301	20210428	413301	1364.05	194.25
236	300ETF 沽 4 月 4700	20210301	20210428	940262	271.53	441.92
237	300ETF 购 3 月 4600	20210309	20210324	12825	57.46	5.90
238	300ETF 沽 3 月 4600	20210309	20210324	82422	5.76	37.91
239	300ETF 购 4 月 4600	20210309	20210428	63400	270.15	29.16
240	300ETF 沽 4 月 4600	20210309	20210428	711598	160.73	327.34
241	300ETF 购 6 月 4600	20210309	20210623	12891	69.68	5.93
242	300ETF 沽 6 月 4600	20210309	20210623	328133	122.86	150.94
243	300ETF 购 9 月 4600	20210309	20210922	109966	379.69	50.58
244	300ETF 沽 9 月 4600	20210309	20210922	1214940	368.89	558.87
245	300ETF 购 4 月 4500	20210325	20210428	26836	141.81	12.08
246	300ETF 沽 4 月 4500	20210325	20210428	197206	14.56	88.74
247	300ETF 购 6 月 4500	20210325	20210623	16432	106.86	7.39
248	300ETF 沽 6 月 4500	20210325	20210623	206687	40.67	93.01
249	300ETF 购 9 月 4500	20210325	20210922	48618	241.81	21.88
250	300ETF 沽 9 月 4500	20210325	20210922	868086	203.93	390.64
251	300ETF 购 5 月 4500	20210325	20210526	18010	105.66	8.10
252	300ETF 购 5 月 4600	20210325	20210526	22301	108.24	10.26

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

253	300ETF 购 5 月 4700	20210325	20210526	134689	475.85	63.30
254	300ETF 购 5 月 4800	20210325	20210526	710811	1974.68	341.19
255	300ETF 购 5 月 4900	20210325	20210526	1806000	3476.63	884.94
256	300ETF 购 5 月 5000	20210325	20210526	6411597	8561.51	3205.80
257	300ETF 购 5 月 5250	20210325	20210526	6891756	2493.62	3618.17
258	300ETF 购 5 月 5500	20210325	20210526	1135546	115.63	624.55
259	300ETF 购 5 月 5750	20210325	20210526	206897	8.29	118.97
260	300ETF 沽 5 月 4500	20210325	20210526	248776	21.17	111.95
261	300ETF 沽 5 月 4600	20210325	20210526	291563	40.71	134.12
262	300ETF 沽 5 月 4700	20210325	20210526	523031	93.27	245.82
263	300ETF 沽 5 月 4800	20210325	20210526	1035414	273.87	497.00
264	300ETF 沽 5 月 4900	20210325	20210526	2333269	925.49	1143.30
265	300ETF 沽 5 月 5000	20210325	20210526	5667158	3191.47	2833.58
266	300ETF 沽 5 月 5250	20210325	20210526	4174162	6073.12	2191.44
267	300ETF 沽 5 月 5500	20210325	20210526	506976	1850.73	278.84
268	300ETF 沽 5 月 5750	20210325	20210526	28733	175.78	16.52
269	300ETF 购 5 月 6000	20210329	20210526	60029	1.27	36.02
270	300ETF 沽 5 月 6000	20210329	20210526	14963	132.78	8.98
271	300ETF 购 5 月 6250	20210406	20210526	23948	0.21	14.97
272	300ETF 沽 5 月 6250	20210406	20210526	5667	62.89	3.54
273	300ETF 购 12 月 4700	20210429	20211222	201022	629.46	94.48
274	300ETF 购 12 月 4800	20210429	20211222	1003915	2151.77	481.88
275	300ETF 购 12 月 4900	20210429	20211222	3258076	4516.49	1596.46
276	300ETF 购 12 月 5000	20210429	20211222	6088615	5566.57	3044.31
277	300ETF 购 12 月 5250	20210429	20211222	3621132	1465.00	1901.09
278	300ETF 购 12 月 5500	20210429	20211222	1277070	451.81	702.39
279	300ETF 购 12 月 5750	20210429	20211222	904251	217.52	519.94
280	300ETF 购 12 月 6000	20210429	20211222	812852	150.13	487.71
281	300ETF 购 12 月 6250	20210429	20211222	632283	108.41	395.18
282	300ETF 沽 12 月 4700	20210429	20211222	1510243	935.28	709.81
283	300ETF 沽 12 月 4800	20210429	20211222	2017638	1437.42	968.47
284	300ETF 沽 12 月 4900	20210429	20211222	3236847	2323.85	1586.06
285	300ETF 沽 12 月 5000	20210429	20211222	5411891	4176.50	2705.95
286	300ETF 沽 12 月 5250	20210429	20211222	1728723	3342.59	907.58
287	300ETF 沽 12 月 5500	20210429	20211222	126101	542.37	69.36
288	300ETF 沽 12 月 5750	20210429	20211222	21368	156.91	12.29
289	300ETF 沽 12 月 6000	20210429	20211222	11542	114.23	6.93
290	300ETF 沽 12 月 6250	20210429	20211222	15320	185.40	9.58
291	300ETF 购 12 月 4600	20210507	20211222	57136	258.81	26.28
292	300ETF 沽 12 月 4600	20210507	20211222	1259581	728.35	579.41
293	300ETF 购 7 月 4700	20210527	20210728	120133	281.77	56.46
294	300ETF 购 7 月 4800	20210527	20210728	424048	709.97	203.54
295	300ETF 购 7 月 4900	20210527	20210728	1392609	3123.70	682.38

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

296	300ETF 购 7 月 5000	20210527	20210728	5074868	8827.16	2537.43
297	300ETF 购 7 月 5250	20210527	20210728	9347390	5179.21	4907.38
298	300ETF 购 7 月 5500	20210527	20210728	2790406	741.12	1534.72
299	300ETF 购 7 月 5750	20210527	20210728	713381	112.24	410.19
300	300ETF 购 7 月 6000	20210527	20210728	240052	27.65	144.03
301	300ETF 购 7 月 6250	20210527	20210728	108137	5.53	67.59
302	300ETF 沽 7 月 4700	20210527	20210728	429752	30.54	201.98
303	300ETF 沽 7 月 4800	20210527	20210728	816407	124.04	391.88
304	300ETF 沽 7 月 4900	20210527	20210728	1695559	454.95	830.82
305	300ETF 沽 7 月 5000	20210527	20210728	5294005	1845.34	2647.00
306	300ETF 沽 7 月 5250	20210527	20210728	7729833	9862.92	4058.16
307	300ETF 沽 7 月 5500	20210527	20210728	1448339	4726.88	796.59
308	300ETF 沽 7 月 5750	20210527	20210728	77254	440.84	44.42
309	300ETF 沽 7 月 6000	20210527	20210728	11794	98.46	7.08
310	300ETF 沽 7 月 6250	20210527	20210728	5024	54.00	3.14
311	300ETF 购 7 月 4600	20210617	20210728	32202	151.25	14.81
312	300ETF 沽 7 月 4600	20210617	20210728	171787	5.48	79.02
313	300ETF 购 8 月 4700	20210624	20210825	725088	1602.14	340.79
314	300ETF 购 8 月 4800	20210624	20210825	2406665	3524.70	1155.20
315	300ETF 购 8 月 4900	20210624	20210825	5178355	4528.55	2537.39
316	300ETF 购 8 月 5000	20210624	20210825	7279936	4674.27	3639.97
317	300ETF 购 8 月 5250	20210624	20210825	3613977	1229.70	1897.34
318	300ETF 购 8 月 5500	20210624	20210825	1033212	198.60	568.27
319	300ETF 购 8 月 5750	20210624	20210825	288336	27.17	165.79
320	300ETF 购 8 月 6000	20210624	20210825	91831	4.01	55.10
321	300ETF 购 8 月 6250	20210624	20210825	53975	1.20	33.73
322	300ETF 沽 8 月 4700	20210624	20210825	1563601	398.48	734.89
323	300ETF 沽 8 月 4800	20210624	20210825	3457953	1324.52	1659.82
324	300ETF 沽 8 月 4900	20210624	20210825	6150070	3316.29	3013.53
325	300ETF 沽 8 月 5000	20210624	20210825	7768893	6433.48	3884.45
326	300ETF 沽 8 月 5250	20210624	20210825	2186821	5387.98	1148.08
327	300ETF 沽 8 月 5500	20210624	20210825	197655	901.46	108.71
328	300ETF 沽 8 月 5750	20210624	20210825	31441	222.27	18.08
329	300ETF 沽 8 月 6000	20210624	20210825	7612	78.76	4.57
330	300ETF 沽 8 月 6250	20210624	20210825	4924	63.63	3.08
331	300ETF 购 8 月 4600	20210705	20210825	168193	519.08	77.37
332	300ETF 沽 8 月 4600	20210705	20210825	717754	118.90	330.17
333	300ETF 购 7 月 4400	20210728	20210728	631	2.60	0.28
334	300ETF 购 7 月 4500	20210728	20210728	1936	5.89	0.87
335	300ETF 沽 7 月 4400	20210728	20210728	489	0.00	0.22
336	300ETF 沽 7 月 4500	20210728	20210728	3805	0.02	1.71
337	300ETF 购 8 月 4400	20210728	20210825	22510	114.92	9.90
338	300ETF 购 8 月 4500	20210728	20210825	21619	88.25	9.73

339	300ETF 沽 8 月 4400	20210728	20210825	192801	13.74	84.83
340	300ETF 沽 8 月 4500	20210728	20210825	246324	27.99	110.85
341	300ETF 购 9 月 4400	20210728	20210922	22588	119.80	9.94
342	300ETF 沽 9 月 4400	20210728	20210922	278116	23.66	122.37
343	300ETF 购 12 月 4400	20210728	20211222	40610	232.18	17.87
344	300ETF 购 12 月 4500	20210728	20211222	29062	138.54	13.08
345	300ETF 沽 12 月 4400	20210728	20211222	793043	222.95	348.94
346	300ETF 沽 12 月 4500	20210728	20211222	813905	358.41	366.26
347	300ETF 购 3 月 4400	20210729	20220323	27958	167.20	12.30
348	300ETF 购 3 月 4500	20210729	20220323	9735	50.42	4.38
349	300ETF 购 3 月 4600	20210729	20220323	12815	56.90	5.89
350	300ETF 购 3 月 4700	20210729	20220323	23059	85.02	10.84
351	300ETF 购 3 月 4800	20210729	20220323	55348	169.39	26.57
352	300ETF 购 3 月 4900	20210729	20220323	164802	398.14	80.75
353	300ETF 购 3 月 5000	20210729	20220323	502653	976.58	251.33
354	300ETF 购 3 月 5250	20210729	20220323	593358	631.73	311.51
355	300ETF 购 3 月 5500	20210729	20220323	681106	353.11	374.61
356	300ETF 沽 3 月 4400	20210729	20220323	937108	260.14	412.33
357	300ETF 沽 3 月 4500	20210729	20220323	695564	249.67	313.00
358	300ETF 沽 3 月 4600	20210729	20220323	581363	327.36	267.43
359	300ETF 沽 3 月 4700	20210729	20220323	554493	420.14	260.61
360	300ETF 沽 3 月 4800	20210729	20220323	404529	421.15	194.17
361	300ETF 沽 3 月 4900	20210729	20220323	379232	537.52	185.82
362	300ETF 沽 3 月 5000	20210729	20220323	449905	782.07	224.95
363	300ETF 沽 3 月 5250	20210729	20220323	157752	504.70	82.82
364	300ETF 沽 3 月 5500	20210729	20220323	19107	104.96	10.51
365	300ETF 购 3 月 5750	20210730	20220323	811100	192.06	466.38
366	300ETF 沽 3 月 5750	20210730	20220323	5022	41.23	2.89
367	300ETF 购 3 月 6000	20210803	20220323	787959	111.09	472.78
368	300ETF 沽 3 月 6000	20210803	20220323	7128	75.40	4.28
369	300ETF 购 10 月 4600	20210826	20211027	58191	213.83	26.77
370	300ETF 购 10 月 4700	20210826	20211027	217941	606.97	102.43
371	300ETF 购 10 月 4800	20210826	20211027	1127730	2186.08	541.31
372	300ETF 购 10 月 4900	20210826	20211027	3779729	4595.11	1852.07
373	300ETF 购 10 月 5000	20210826	20211027	6689566	4405.78	3344.78
374	300ETF 购 10 月 5250	20210826	20211027	2094835	412.81	1099.79
375	300ETF 购 10 月 5500	20210826	20211027	363714	30.94	200.04
376	300ETF 购 10 月 5750	20210826	20211027	81975	3.34	47.14
377	300ETF 购 10 月 6000	20210826	20211027	31426	0.57	18.86
378	300ETF 沽 10 月 4600	20210826	20211027	602526	121.52	277.16
379	300ETF 沽 10 月 4700	20210826	20211027	975259	297.63	458.37
380	300ETF 沽 10 月 4800	20210826	20211027	2068787	929.94	993.02
381	300ETF 沽 10 月 4900	20210826	20211027	4073921	2505.80	1996.22

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

382	300ETF 沽 10 月 5000	20210826	20211027	5291997	4149.90	2646.00
383	300ETF 沽 10 月 5250	20210826	20211027	787225	2193.63	413.29
384	300ETF 沽 10 月 5500	20210826	20211027	47001	251.62	25.85
385	300ETF 沽 10 月 5750	20210826	20211027	6371	50.77	3.66
386	300ETF 沽 10 月 6000	20210826	20211027	5023	51.38	3.01
387	300ETF 购 10 月 4500	20210827	20211027	19412	90.48	8.74
388	300ETF 沽 10 月 4500	20210827	20211027	373597	46.02	168.12
389	300ETF 购 11 月 4500	20210923	20211124	15339	70.95	6.90
390	300ETF 购 11 月 4600	20210923	20211124	42102	150.16	19.37
391	300ETF 购 11 月 4700	20210923	20211124	229838	576.20	108.02
392	300ETF 购 11 月 4800	20210923	20211124	1108077	1816.44	531.88
393	300ETF 购 11 月 4900	20210923	20211124	3896985	3709.98	1909.52
394	300ETF 购 11 月 5000	20210923	20211124	5783522	3055.77	2891.76
395	300ETF 购 11 月 5250	20210923	20211124	1621979	300.34	851.54
396	300ETF 购 11 月 5500	20210923	20211124	233521	14.90	128.44
397	300ETF 购 11 月 5750	20210923	20211124	46217	1.24	26.57
398	300ETF 沽 11 月 4500	20210923	20211124	226941	19.20	102.12
399	300ETF 沽 11 月 4600	20210923	20211124	424149	48.59	195.11
400	300ETF 沽 11 月 4700	20210923	20211124	933118	161.70	438.57
401	300ETF 沽 11 月 4800	20210923	20211124	1919814	575.65	921.51
402	300ETF 沽 11 月 4900	20210923	20211124	3842326	1986.74	1882.74
403	300ETF 沽 11 月 5000	20210923	20211124	4688482	4125.25	2344.24
404	300ETF 沽 11 月 5250	20210923	20211124	603316	1786.18	316.74
405	300ETF 沽 11 月 5500	20210923	20211124	26095	141.12	14.35
406	300ETF 沽 11 月 5750	20210923	20211124	8371	64.65	4.81
407	300ETF 购 11 月 6000	20210928	20211124	17923	0.17	10.75
408	300ETF 沽 11 月 6000	20210928	20211124	3851	39.63	2.31
409	300ETF 购 6 月 4600	20211028	20220622	6543	33.82	3.01
410	300ETF 购 6 月 4700	20211028	20220622	5106	23.47	2.40
411	300ETF 购 6 月 4800	20211028	20220622	4825	17.50	2.32
412	300ETF 购 6 月 4900	20211028	20220622	9362	29.11	4.59
413	300ETF 购 6 月 5000	20211028	20220622	48559	129.79	24.28
414	300ETF 购 6 月 5250	20211028	20220622	53559	90.32	28.12
415	300ETF 购 6 月 5500	20211028	20220622	84887	85.35	46.69
416	300ETF 购 6 月 5750	20211028	20220622	61150	36.78	35.16
417	300ETF 购 6 月 6000	20211028	20220622	89952	31.21	53.97
418	300ETF 沽 6 月 4600	20211028	20220622	75144	74.26	34.57
419	300ETF 沽 6 月 4700	20211028	20220622	52145	65.30	24.51
420	300ETF 沽 6 月 4800	20211028	20220622	44105	66.61	21.17
421	300ETF 沽 6 月 4900	20211028	20220622	31251	64.21	15.31
422	300ETF 沽 6 月 5000	20211028	20220622	46022	110.32	23.01
423	300ETF 沽 6 月 5250	20211028	20220622	19126	67.41	10.04
424	300ETF 沽 6 月 5500	20211028	20220622	8502	45.84	4.68

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

425	300ETF 沽 6 月 5750	20211028	20220622	3297	24.72	1.90
426	300ETF 沽 6 月 6000	20211028	20220622	3175	31.30	1.91
427	300ETF 购 6 月 4500	20211029	20220622	8677	51.42	3.90
428	300ETF 沽 6 月 4500	20211029	20220622	107439	82.74	48.35
429	300ETF 购 1 月 4600	20211125	20220126	9352	40.64	4.30
430	300ETF 购 1 月 4700	20211125	20220126	35269	118.75	16.58
431	300ETF 购 1 月 4800	20211125	20220126	151719	371.81	72.83
432	300ETF 购 1 月 4900	20211125	20220126	713063	1166.36	349.40
433	300ETF 购 1 月 5000	20211125	20220126	2333096	2471.50	1166.55
434	300ETF 购 1 月 5250	20211125	20220126	1686203	665.49	885.26
435	300ETF 购 1 月 5500	20211125	20220126	558909	93.92	307.40
436	300ETF 购 1 月 5750	20211125	20220126	149816	11.20	86.14
437	300ETF 购 1 月 6000	20211125	20220126	62190	2.42	37.31
438	300ETF 沽 1 月 4600	20211125	20220126	228006	26.17	104.88
439	300ETF 沽 1 月 4700	20211125	20220126	427998	73.46	201.16
440	300ETF 沽 1 月 4800	20211125	20220126	655796	169.23	314.78
441	300ETF 沽 1 月 4900	20211125	20220126	1156710	499.15	566.79
442	300ETF 沽 1 月 5000	20211125	20220126	2259615	1666.27	1129.81
443	300ETF 沽 1 月 5250	20211125	20220126	650758	1484.91	341.65
444	300ETF 沽 1 月 5500	20211125	20220126	29719	129.61	16.35
445	300ETF 沽 1 月 5750	20211125	20220126	4471	30.96	2.57
446	300ETF 沽 1 月 6000	20211125	20220126	2130	20.17	1.28
447	300ETF 购 1 月 4500	20211129	20220126	4966	27.53	2.23
448	300ETF 沽 1 月 4500	20211129	20220126	89721	4.86	40.37
449	300ETF 购 1 月 6250	20211210	20220126	23248	0.50	14.53
450	300ETF 沽 1 月 6250	20211210	20220126	571	6.74	0.36
451	300ETF 购 3 月 6250	20211210	20220323	157563	10.42	98.48
452	300ETF 沽 3 月 6250	20211210	20220323	1493	17.24	0.93
453	300ETF 购 6 月 6250	20211210	20220622	31529	6.11	19.71
454	300ETF 沽 6 月 6250	20211210	20220622	606	7.04	0.38
455	300ETF 购 2 月 4600	20211223	20220223	1223	5.44	0.56
456	300ETF 购 2 月 4700	20211223	20220223	855	2.99	0.40
457	300ETF 购 2 月 4800	20211223	20220223	3005	8.02	1.44
458	300ETF 购 2 月 4900	20211223	20220223	10858	21.22	5.32
459	300ETF 购 2 月 5000	20211223	20220223	66271	90.18	33.14
460	300ETF 购 2 月 5250	20211223	20220223	75242	35.06	39.50
461	300ETF 购 2 月 5500	20211223	20220223	32057	4.92	17.63
462	300ETF 购 2 月 5750	20211223	20220223	11847	0.82	6.81
463	300ETF 购 2 月 6000	20211223	20220223	3433	0.12	2.06
464	300ETF 沽 2 月 4600	20211223	20220223	13482	1.94	6.20
465	300ETF 沽 2 月 4700	20211223	20220223	27645	6.80	12.99
466	300ETF 沽 2 月 4800	20211223	20220223	52641	22.17	25.27
467	300ETF 沽 2 月 4900	20211223	20220223	47612	32.91	23.33

## 上海证券交易所股票期权市场发展报告（2021）

468	300ETF 沽 2 月 5000	20211223	20220223	74431	81.53	37.22
469	300ETF 沽 2 月 5250	20211223	20220223	11291	30.35	5.93
470	300ETF 沽 2 月 5500	20211223	20220223	1251	6.07	0.69
471	300ETF 沽 2 月 5750	20211223	20220223	88	0.63	0.05
472	300ETF 沽 2 月 6000	20211223	20220223	77	0.75	0.05