

股指期货期权部分								
历史波动率		5日	10日	20日	40日	60日	120日	250日
	沪深300股指期货	34.99%	27.29%	22.07%	29.13%	24.58%	19.26%	21.41%
	分位数水平	89.70%	77.50%	61.20%	79.40%	65.50%	34.70%	51.30%
	沪深300ETF期权（沪）	34.95%	27.40%	22.58%	30.49%	25.69%	19.98%	21.79%
	分位数水平	92.30%	84.10%	71.90%	86.60%	76.40%	51.60%	56.50%
	沪深300ETF期权（深）	34.36%	27.23%	22.11%	29.03%	24.44%	19.20%	21.13%
	分位数水平	92.20%	84.60%	72.40%	85.50%	75.30%	48.10%	53.30%
	上证50ETF期权	29.20%	23.68%	19.32%	26.53%	22.48%	17.83%	20.66%
分位数水平	81.10%	65.00%	45.60%	66.40%	50.70%	25.10%	35.20%	
隐含波动率		3月	4月	5月	6月	9月	12月	
	沪深300股指期货	25.66%	24.85%	23.31%	22.97%	22.27%	22.28%	
	沪深300ETF期权（沪）	22.68%	22.46%	合约未推出	22.17%	22.16%	合约未推出	
	沪深300ETF期权（深）	23.23%	22.45%	合约未推出	22.10%	22.17%	合约未推出	
	上证50ETF期权	19.91%	20.02%	合约未推出	20.07%	20.39%	合约未推出	
	分位数水平	49.90%	49.90%	——	49.90%	50.60%	——	
	注：沪深300指数期权和ETF期权隐含波动率数据偏少，暂不记录分位数水平							
认购认沽比		持仓量	分位数水平		成交量		分位数水平	
	上证50ETF期权	1.22	47.70%		1.15		27.40%	
	注：沪深300指数期权和ETF期权持仓和成交量数据偏少，暂不记录							
成交量前五	认购			认沽				
	期权简称		日成交量(张)		期权简称		日成交量(张)	
	沪深300指数期权2003C4200		3,444		沪深300指数期权2003P4000		2,148	
	沪深300指数期权2003C4100		3379		沪深300指数期权2003P4100		1950	
	沪深300指数期权2003C4150		1922		沪深300指数期权2003P3800		1738	
	沪深300指数期权2003C4300		1462		沪深300指数期权2003P4050		1280	
	沪深300指数期权2003C4000		1,429		沪深300指数期权2003P3900		1,115	
持仓量前五	期权简称		日持仓量(张)	持仓增加（张）	期权简称		日持仓量(张)	持仓增加（张）
	沪深300指数期权2003C4200		2086	-247	沪深300指数期权2003P3800		1939	71
	沪深300指数期权2003C4100		1973	37	沪深300指数期权2003P3600		1898	41
	沪深300指数期权2003C4000		1669	-112	沪深300指数期权2003P3300		1813	-69
	沪深300指数期权2003C4300		1384	-90	沪深300指数期权2003P3700		1794	-51
	沪深300指数期权2003C4150		1353	206	沪深300指数期权2003P4000		1624	106
持仓量增加前五	期权简称		日持仓量(张)	持仓增加（张）	期权简称		日持仓量(张)	持仓增加（张）
	沪深300指数期权2003C4150		1353	206	沪深300指数期权2003P4100		1159	152
	沪深300指数期权2004C3900		759	134	沪深300指数期权2004P3300		816	132
	沪深300指数期权2004C4650		679	127	沪深300指数期权2004P3650		546	106
	沪深300指数期权2004C4300		532	95	沪深300指数期权2003P4000		1624	106
	沪深300指数期权2006C3900		663	87	沪深300指数期权2003P3750		1338	95
报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。								