

场外期权账户
周账单

联系人: 王翔
 联系电话: 021-58205157
 Email: wangx01@ghlsqh.com.cn

场外期权周报

净资产值

客户风险率	00.00
当前权益	96,682,281.18
可用资金	96,682,281.18
可取资金	96,682,281.18
交易所风险率	00.00
交易手续费	-84,992.30
持仓盈亏	00.00
持仓保证金	00.00

合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1602	0	-736,945.77
IH1602	0	-790,287.36
IC1602	0	-2,168,749.17

国海良时期货有限公司

地 址: 杭州市河东路91号

邮 编: 310014

传 真: 0571-85237426

网 址: www.ghlsqh.com.cn

场外期权合约参数

期权模拟类型	欧式看跌期权
标的物	沪深 300 指数 (000300)
复制合约	IF1602
期权到期日	2016 年 2 月 19 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	3174.38
行权价	3170.0 点
套保资产总值	47,615,700.00 元
套保起始日期	2016 年 1 月 20 日
合约权利金 (参考)	3,957,672.00 元
标的收盘价	3051.58
期权状态	价内
内在价值	1,776,300.00 元

模拟说明：以沪深 300 指数期货复制沪深 300 指数为标的的看跌期权，看跌期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 1 月 20 日沪深 300 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.4625)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上 (该合约权利金附加名义价值的 3.16% 作为对基差成本修正)。

期权模拟类型	欧式看涨期权
标的物	上证 50 指数 (000016)
复制合约	IH1602
期权到期日	2016 年 2 月 19 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	2088.72
行权价	2090.0 点
套保资产总值	34,764,750.00 元
套保起始日期	2016 年 1 月 20 日
合约权利金 (参考)	1,430,665.00 元
标的收盘价	2004.11
期权状态	价外
内在价值	0.00 元

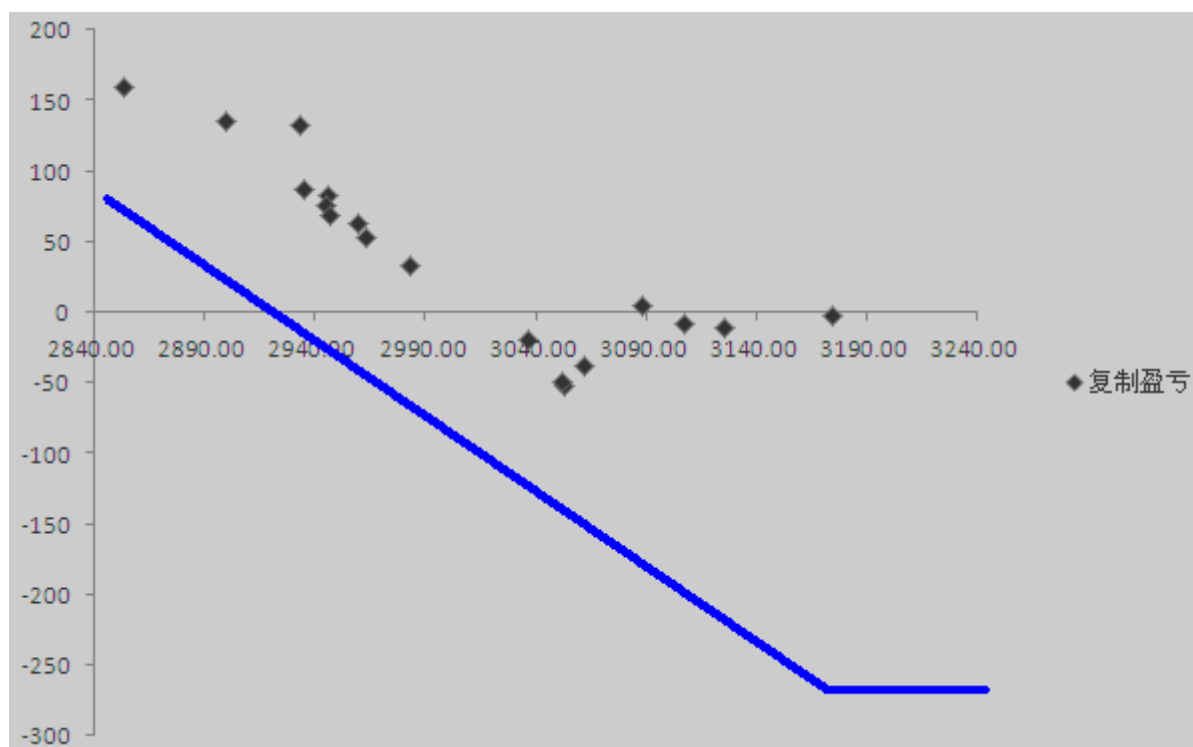
模拟说明：以上证 50 指数期货复制上证 50 指数为标的的看涨期权，看涨期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 1 月 20 日上证 50 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.4023)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

期权模拟类型	亚式算术平均固定行权价看涨期权
标的物	中证 500 指数 (399905)
复制合约	IC1602
期权到期日	2016 年 2 月 19 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	5886.87
行权价	5800.0 点
套保资产总值	58,868,700.00 元
套保起始日期	2016 年 1 月 21 日
合约权利金 (参考)	2,386,489.00 元
标的收盘价	5979.52
结算方式	期限内标的的每日收盘价格的算术平均
最终结算价格	5718.4176 (价外-应付: 0 元)

模拟说明：以中证 500 指数期货复制中证 500 指数为标的的亚式算术平均固定行权价看涨期权，该期权初始为实值期权，期权到期结算价格为 2016 年 1 月 21 日至 2016 年 2 月 19 日每个交易日中证 500 指数收盘价格的算术平均价。以 2016 年 1 月 21 日中证 500 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.5708)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

当前合约权益图

A. 沪深 300 指数欧式看跌期权



B. 上证50指数欧式看涨期权

