

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	27.90%
当前权益	90,039,384.43
可用资金	64,919,213.83
可取资金	64,919,213.83
交易所风险率	26.25%
交易手续费	-48,416.75
总盈亏	-6,642,896.75
持仓保证金	25,120,170.60

合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1602	-29	-1,492,211.03
IH1602	49	92,553.94
IC1602	0	-5,243,239.66

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	IF1603
期权到期日	2016 年 3 月 25 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	3109.55
行权价	3110.0 点
套保资产总值	46,643,250.00 元
套保起始日期	2016 年 2 月 24 日
合约权利金 (参考)	3,046,504.80 元
标的收盘价	3093.89
期权状态	价内
内在价值	241,650.00 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 2 月 24 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 (0.4329)，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 2.24% 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	IH1603
期权到期日	2016 年 3 月 25 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	2041.39
行权价	2040.0 点
套保资产总值	30,620,850.00 元
套保起始日期	2016 年 2 月 24 日
合约权利金 (参考)	1,222,098.00 元
标的收盘价	2122.27
期权状态	价内
内在价值	1,234,050.00 元

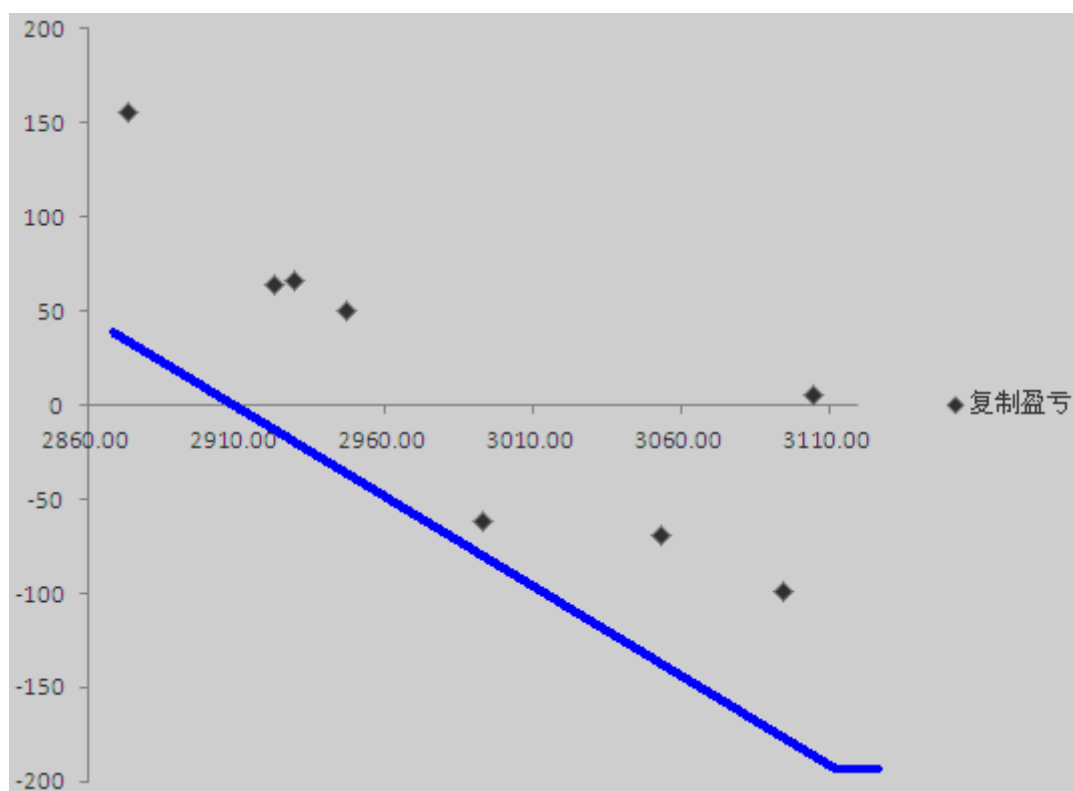
模拟说明：以上证 50 指数期货复制上证 50 指数为标的的看涨期权，看涨期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 2 月 24 日上证 50 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.4071)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

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	IC1603
期权到期日	2016 年 3 月 25 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	6111.03
行权价	5800.0 点
套保资产总值	61,110,300.00 元
套保起始日期	2016 年 2 月 24 日
合约权利金 (参考)	4,005,040.00 元
标的收盘价	5621.55
结算方式	期限内标的每日收盘价格的算术平均
最终结算价格	待确定

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 2 月 24 日至 2016 年 3 月 25 日每个交易日中证 500 指数收盘价格的算术平均价。以 2016 年 2 月 24 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 (0.5900)，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

