

**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	87,395,833.45
可用资金	87,395,833.45
可取资金	87,395,833.45
交易所风险率	00.00%
交易手续费	-70,275.45
总盈亏	-637,989.45
持仓保证金	00.00

### 合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1605	0/0	-232,641.88
IH1605	0/0	-507,444.07
IC1605	0/0	102,096.50

**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	IF1605
期权到期日	2016 年 5 月 20 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	3160.60
行权价	3160.0 点
套保资产总值	47,409,000.00 元
套保起始日期	2016 年 4 月 21 日
合约权利金 (参考)	2,648,000.00 元
标的收盘价	3078.22
期权状态	价内
内在价值	1,226,700.00 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 4 月 21 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 (0.3941)，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 1.29% 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	IH1605
期权到期日	2016 年 5 月 20 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	2147.72
行权价	2150.0 点
套保资产总值	32,215,800.00 元
套保起始日期	2016 年 4 月 21 日
合约权利金 (参考)	1,364,000.00 元
标的收盘价	2083.12
期权状态	价外
内在价值	00.00 元

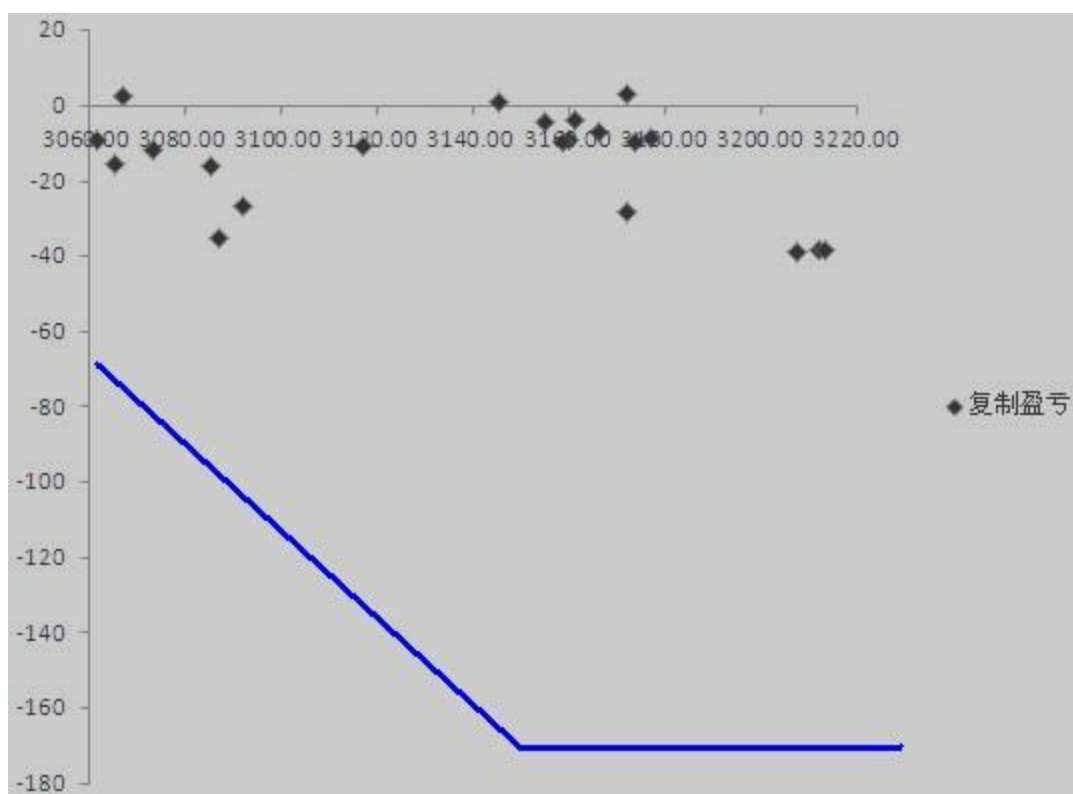
模拟说明：以上证 50 指数期货复制上证 50 指数为标的的看涨期权，看涨期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 4 月 21 日上证 50 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.3795)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

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	IC1605
期权到期日	2016 年 5 月 20 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	5970.67
行权价	5600.0 点
套保资产总值	59,706,700.00 元
套保起始日期	2016 年 4 月 21 日
合约权利金 (参考)	4,180,000.00 元
标的收盘价	5732.89
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	5888.62 (价内: 2,886,200.00)

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 4 月 21 日至 2016 年 5 月 20 日每个交易日中证 500 指数收盘价格的算术平均价。以 2016 年 4 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 (0.4830), 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

