

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	15.61%
当前权益	88,052,676.06
可用资金	74,157,408.66
可取资金	74,157,408.66
交易所风险率	14.53%
交易手续费	-14,732.00
总盈亏	815,548.00
持仓保证金	13,743,287.40

### 合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1605	0/1	-300,495.49
IH1605	19/0	213,506.20
IC1605	15/0	902,537.29

#### 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	IF1607
期权到期日	2016 年 7 月 15 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	3112.67
行权价	3110.0 点
套保资产总值	18,676,020.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 20 日
合约权利金 (参考)	1,059,554.00 元
标的收盘价	3192.28
期权状态	价外
内在价值	00.00 元

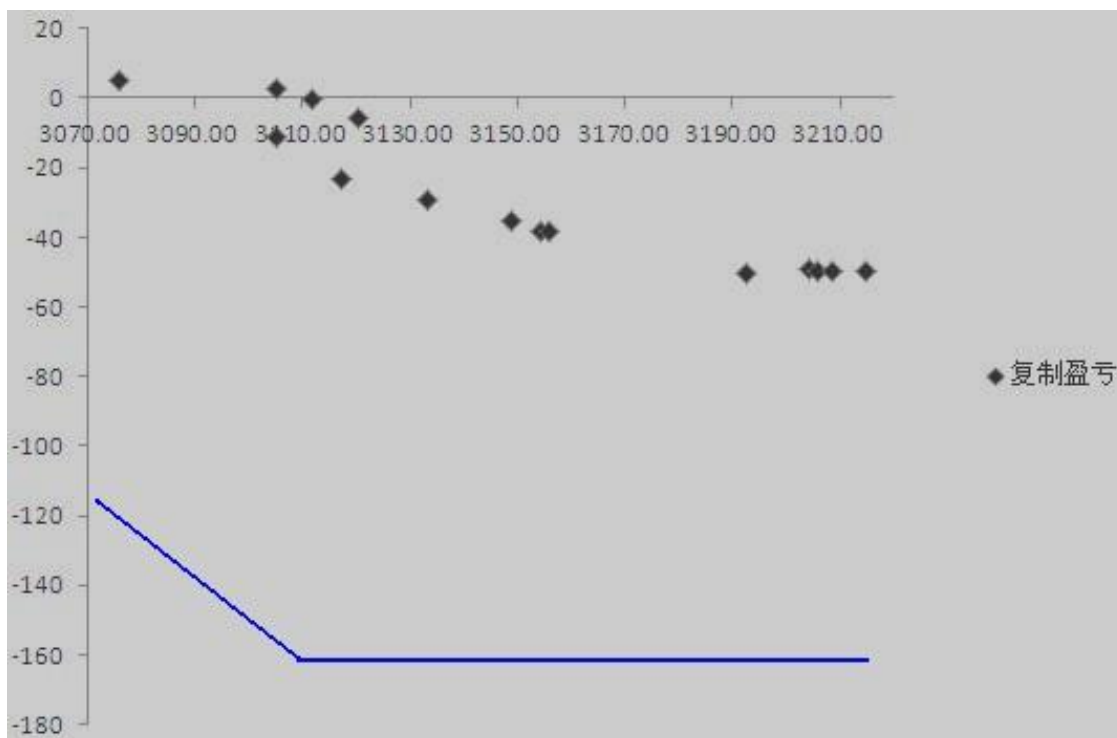
模拟说明：以沪深 300 指数期货复制沪深 300 指数为标的的看跌期权，看跌期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 6 月 20 日沪深 300 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.3519)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上 (该合约权利金附加名义价值的 2.07% 作为对基差成本修正)。

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	IH1607
期权到期日	2016 年 7 月 15 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	2104.22
行权价	2105.0 点
套保资产总值	12,625,320.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 20 日
合约权利金 (参考)	436,459.00 元
标的收盘价	2148.76
期权状态	价内
内在价值	262,560.00 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 6 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 (0.3315)，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

