

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	87,085,148.06
可用资金	87,085,148.06
可取资金	87,085,148.06
交易所风险率	00.00%
交易手续费	-21,205.39
总盈亏	-310,685.39
持仓保证金	00.00

合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1605	0/0	-169,164.69
IH1605	0/0	-180,776.54
IC1605	0/0	39,255.84

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	IF1606
期权到期日	2016 年 6 月 17 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	3167.10
行权价	3160.0 点
套保资产总值	19,002,600.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 2 日
合约权利金 (参考)	723,159.00 元
标的收盘价	3110.36
期权状态	价内
内在价值	297,840.00 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 2 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 (0.3689)，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 0.94% 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	IH1606
期权到期日	2016 年 6 月 17 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	2137.65
行权价	2140.0 点
套保资产总值	12,825,900.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 2 日
合约权利金 (参考)	356,478.00 元
标的收盘价	2102.20
期权状态	价外
内在价值	00.00 元

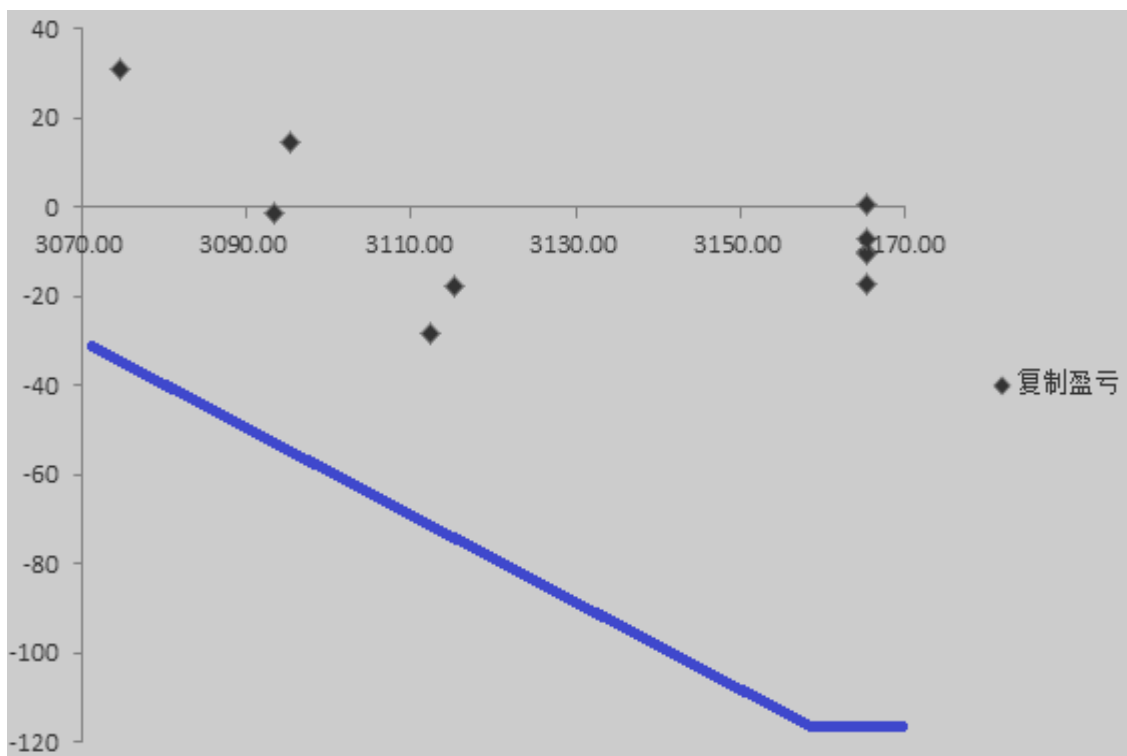
模拟说明：以上证 50 指数期货复制上证 50 指数为标的的看涨期权，看涨期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 6 月 2 日上证 50 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.3795)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

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	IC1606
期权到期日	2016 年 6 月 17 日
无风险收益率 (年化)	1.50%
复制波动率	10.00%
初始标的价格	6013.88
行权价	5600.0 点
套保资产总值	24,055,520.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 2 日
合约权利金 (参考)	1,695,421.00 元
标的收盘价	5964.26
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	5952.45 (总价值: 704,900.00)

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 6 月 2 日至 2016 年 6 月 17 日每个交易日中证 500 指数收盘价格的算术平均价。以 2016 年 6 月 2 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 (0.4651)，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

