

**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	12.13%
当前权益	86,959,338.87
可用资金	76,411,570.07
可取资金	76,411,570.07
交易所风险率	11.41%
交易手续费	-7,769.19
总盈亏	-125,809.19
持仓保证金	10,547,768.80

### 合约信息

合约	净持仓	净盈亏
IF1605	0/13	31,823.12
IH1605	6/0	-67,030.16
IC1605	8/0	-90,602.15

**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	3077.16
期权状态	价内
内在价值	197,040.00 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	2076.30
期权状态	价外
内在价值	00.00 元

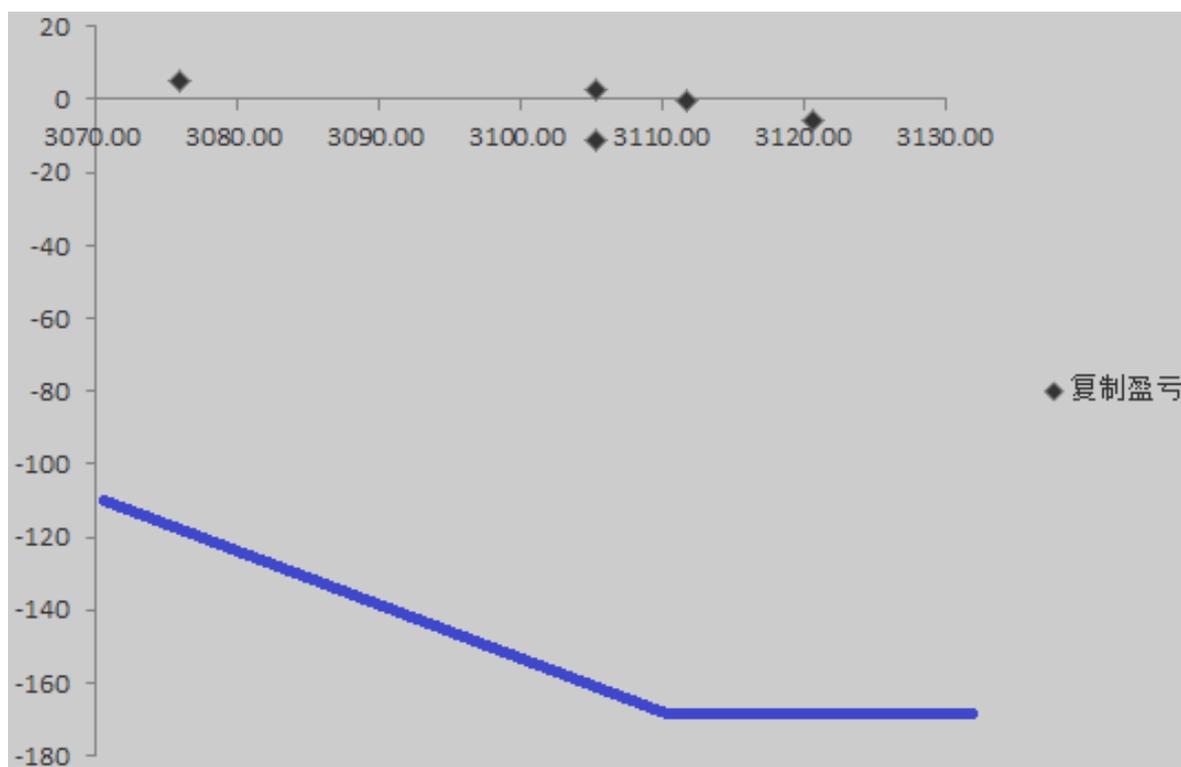
模拟说明：以上证 50 指数期货复制上证 50 指数为标的的看涨期权，看涨期权初始为虚值期权，行权价选取距离标的现价最近的 10 个点数位，以 2016 年 6 月 20 日上证 50 指数的收盘价为基准计算期权权利金。权利金计算的波动率参数选择对应期限的历史波动率 (0.3315)，权利金考虑基差，若基差不利，则基差费用直接附加在权利金上。

期权模拟类型	后付式看涨期权
标的物	中证 500 指数 (399905)
复制合约	IC1607
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	5985.56
行权价	5980.0 点
套保资产总值	23,942,240.00 元
套保起始日期	2016 年 6 月 20 日
合约权利金 (参考)	3,182,776.00 元
标的收盘价	5903.62
结算方式	仅到期时价内支付权利金
最终结算价格	待定

模拟说明：以中证 500 指数期货复制中证 500 指数为标的看涨期权，该期权为后付式期权，期权买方仅在到期期权为实值时才支付权利金。以 2016 年 6 月 20 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 (0.4477)，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

