|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 初始投资 | 100,000 |  |  |
| 初始可以买合约数 | 0.2363 |  |  |
| 每个指数点价值 | 300 |  |  |
| 杠杆率 | 12% |  |  |
| 仓位 | 50% |  |  |
|  | ATM | ATM | 沪深指数 |
| 允许卖空? | **0** | **1** | **0** |
| 复利？ | **0** | **0** | **1** |
| 累计收益 | **698,999** | **1,641,262** | **-58,028** |
| 年化收益 | **36.75%** | **53.77%** | **-12.25%** |
| 单日最大回撤 | **-31,731** | **-38,925** | **-6,668** |
| 5日最大回撤 | **-56,284** | **-49,483** | **-16,038** |
| 10日最大回撤 | **-128,583** | **-90,327** | **-126,366** |