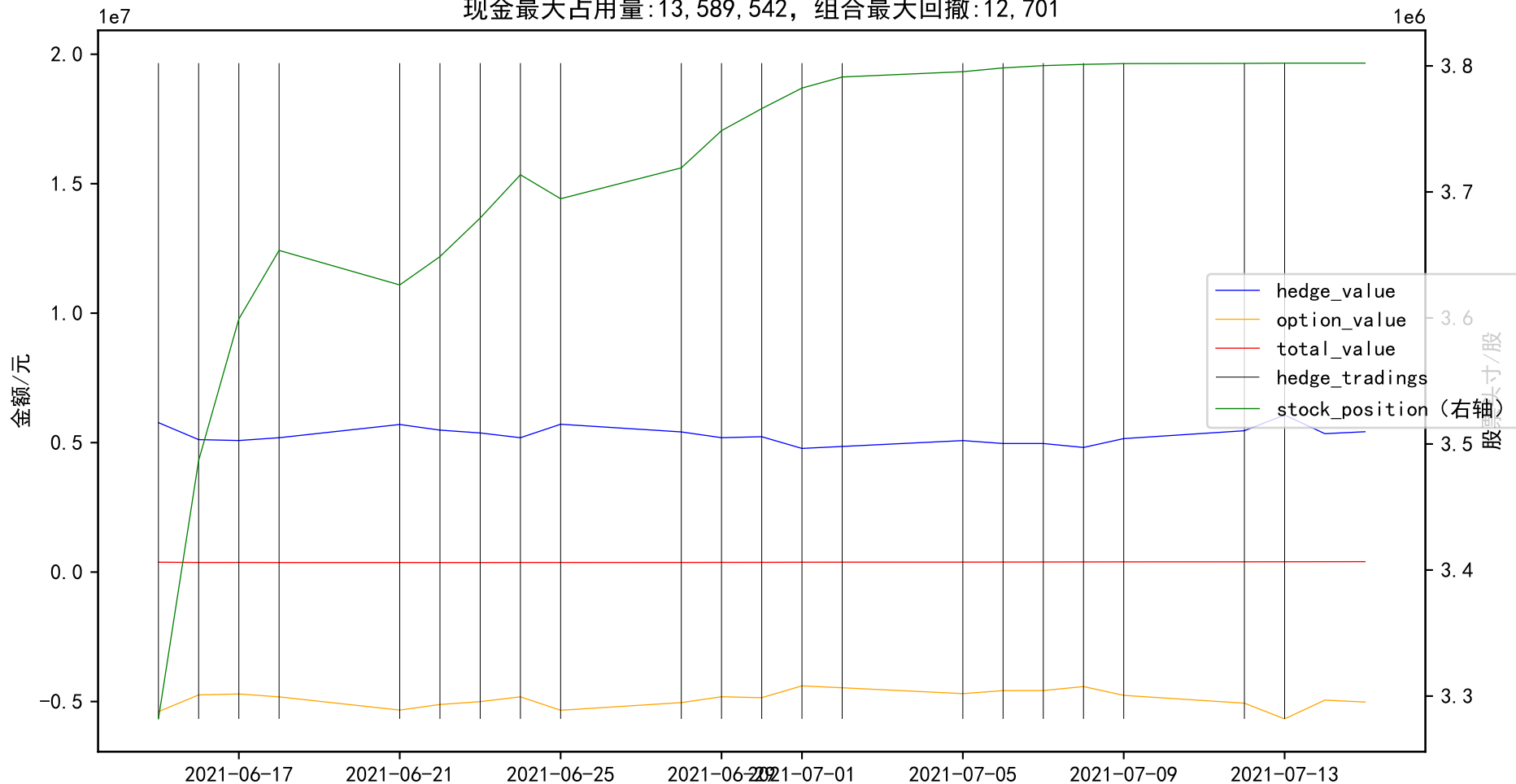


股票期权对冲总览, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79

整体盈利:402,447, 期权损益:756,988, 对冲损益:-350,575, 交易成本:3,967

现金最大占用量:13,589,542, 组合最大回撤:12,701

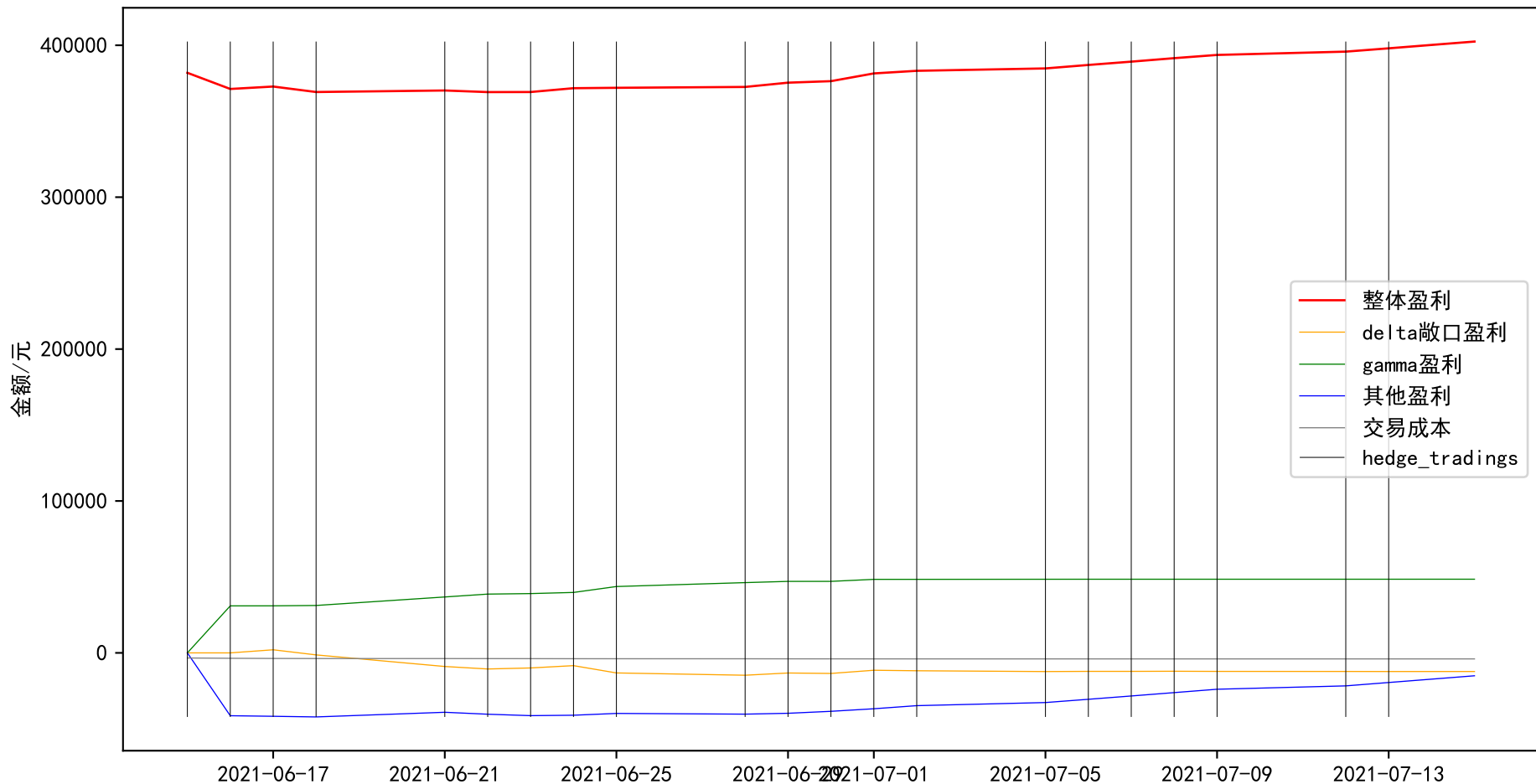


对冲收益分解, 对冲策略: HedgeHalf

期权类型: 看涨价差, 名义金额: 20,000,000, 标的: 300180.SZ, 期权费: 5,776,000, 低执行价: 3.68, 高执行价: 5.79

整体盈利: 402,447, 期权初始价值: -5,390,756, delta敞口盈利: -12,262, gamma盈利: 48,504

其他盈利: -15,072, 交易成本: 3,967

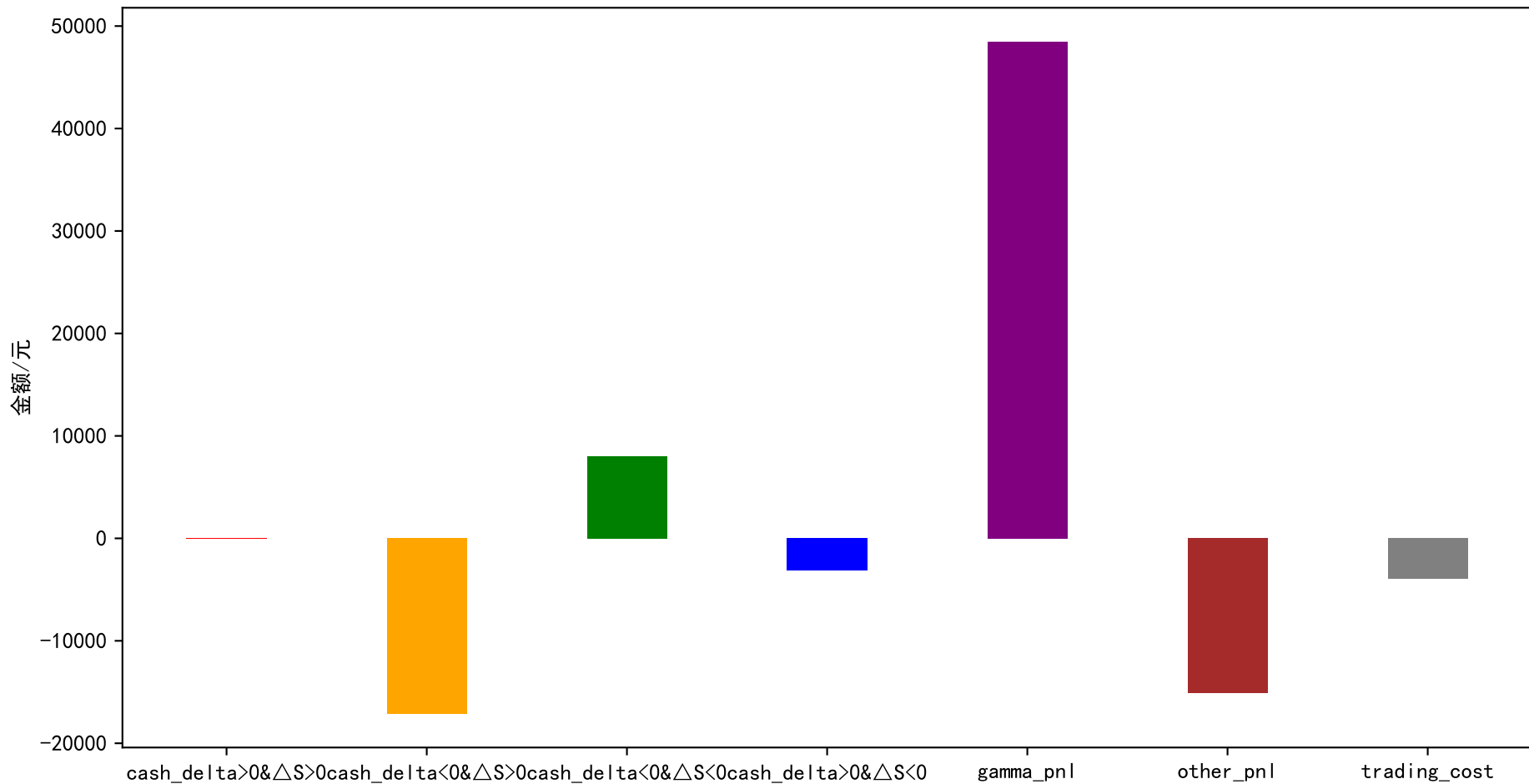


收益拆解，对冲策略:HedgeHalf

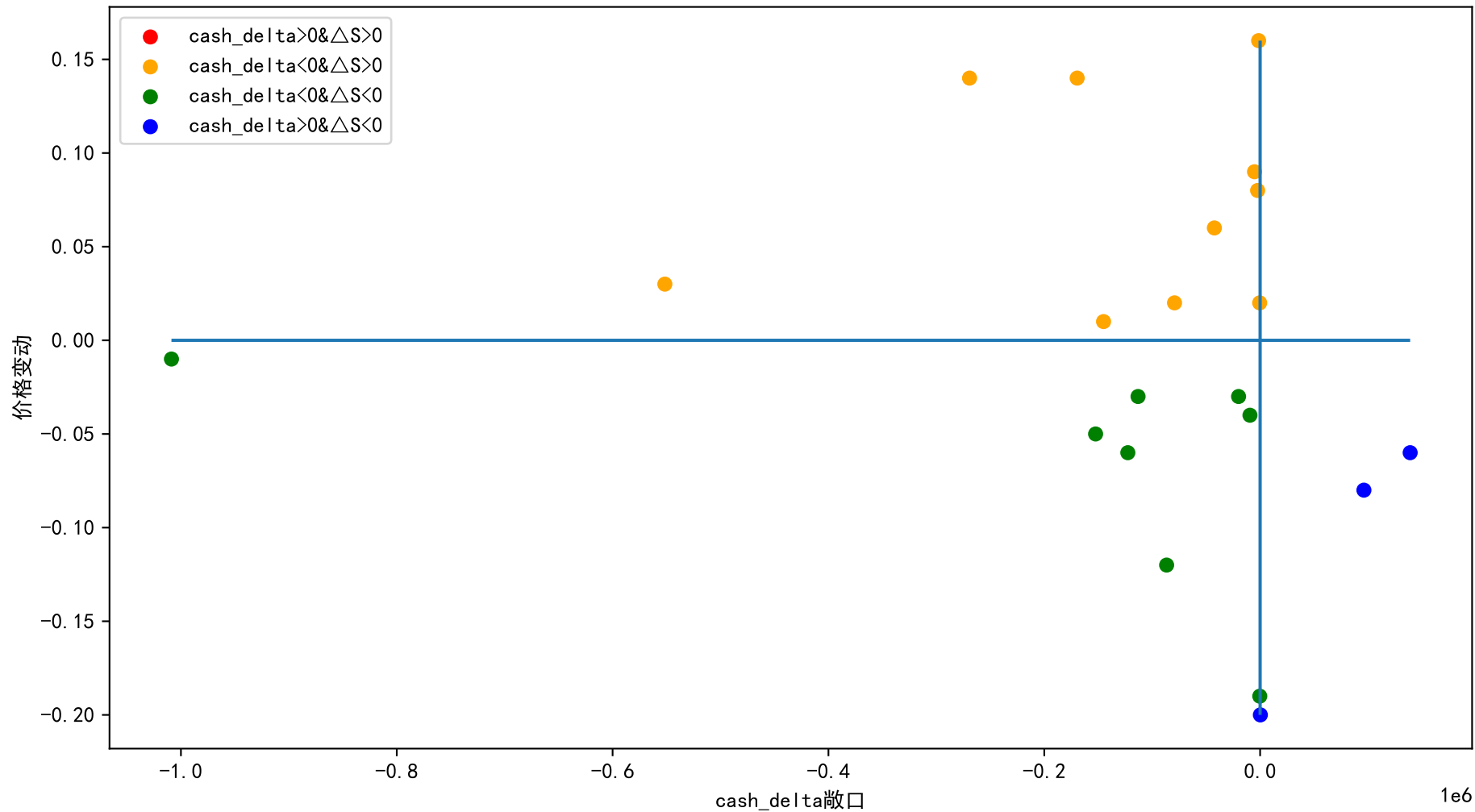
期权类型:看涨价差，名义金额:20,000,000，标的:300180.SZ，期权费:5,776,000，低执行价:3.68，高执行价:5.79

四个累计收益:0 -17,132 8,035 -3,166

gamma收益:48,504，其他盈利:-15,072，交易成本:3,967

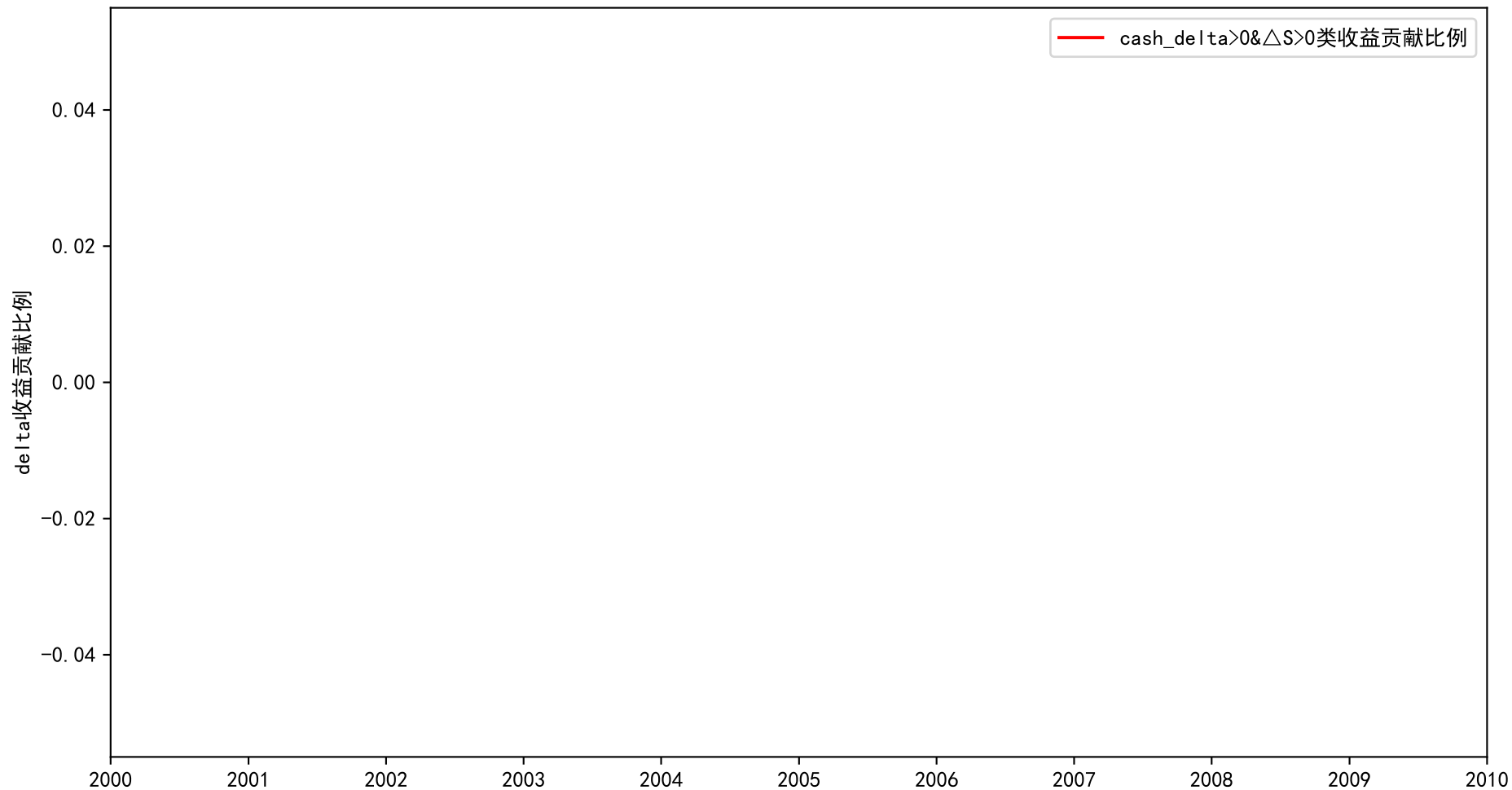


期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



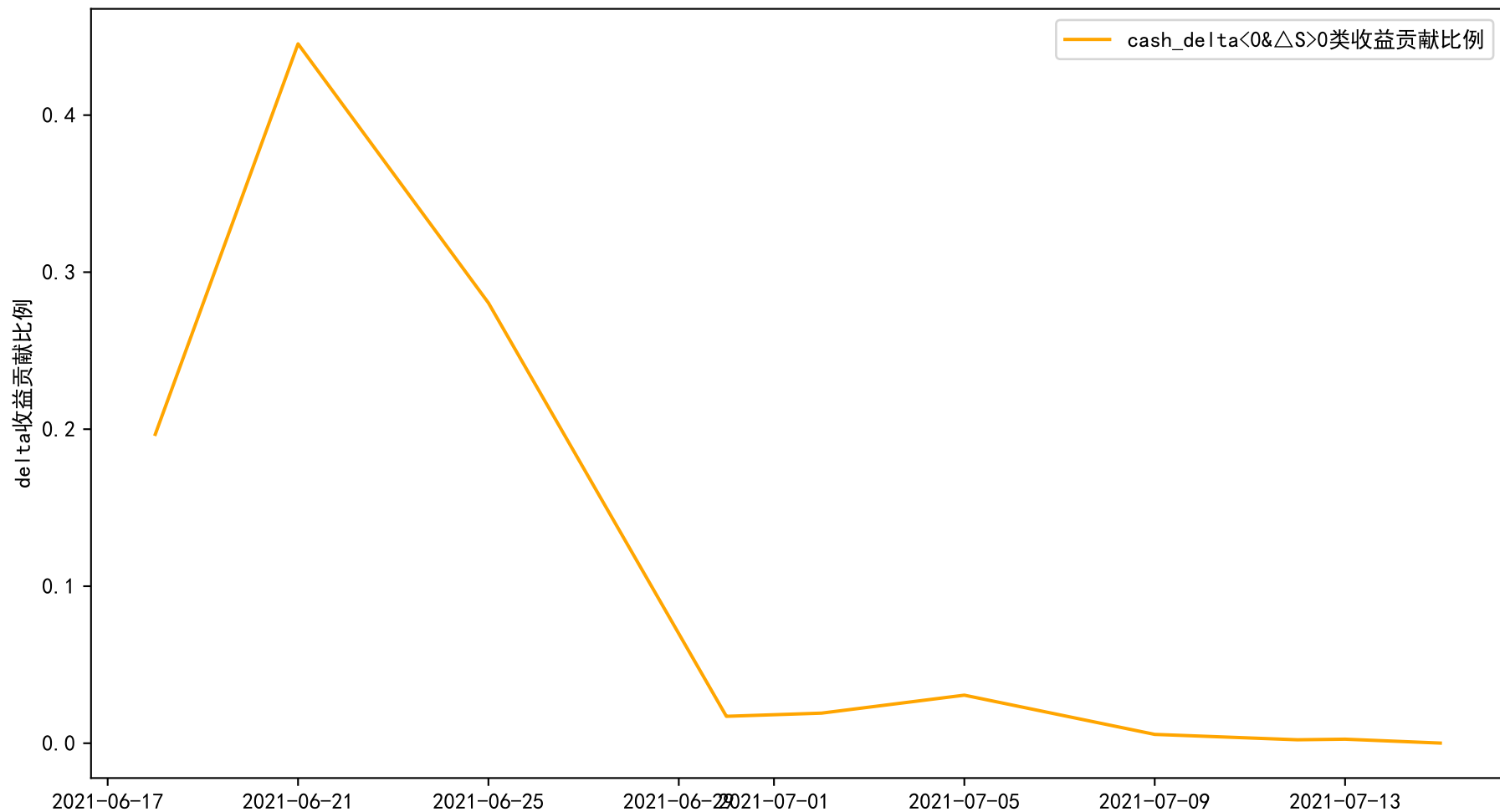
cash_delta>0& ΔS >0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



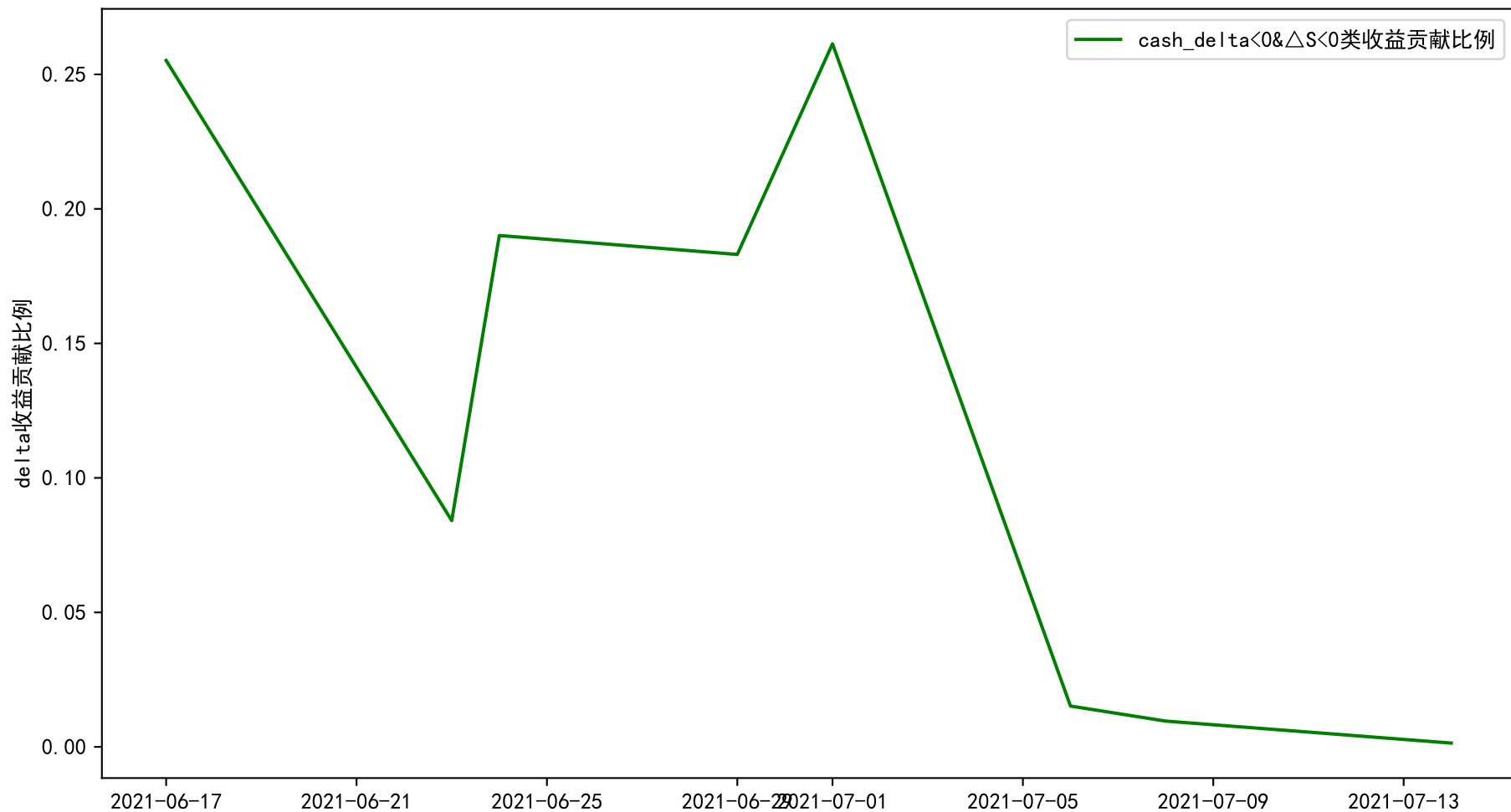
cash_delta<0&△S>0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



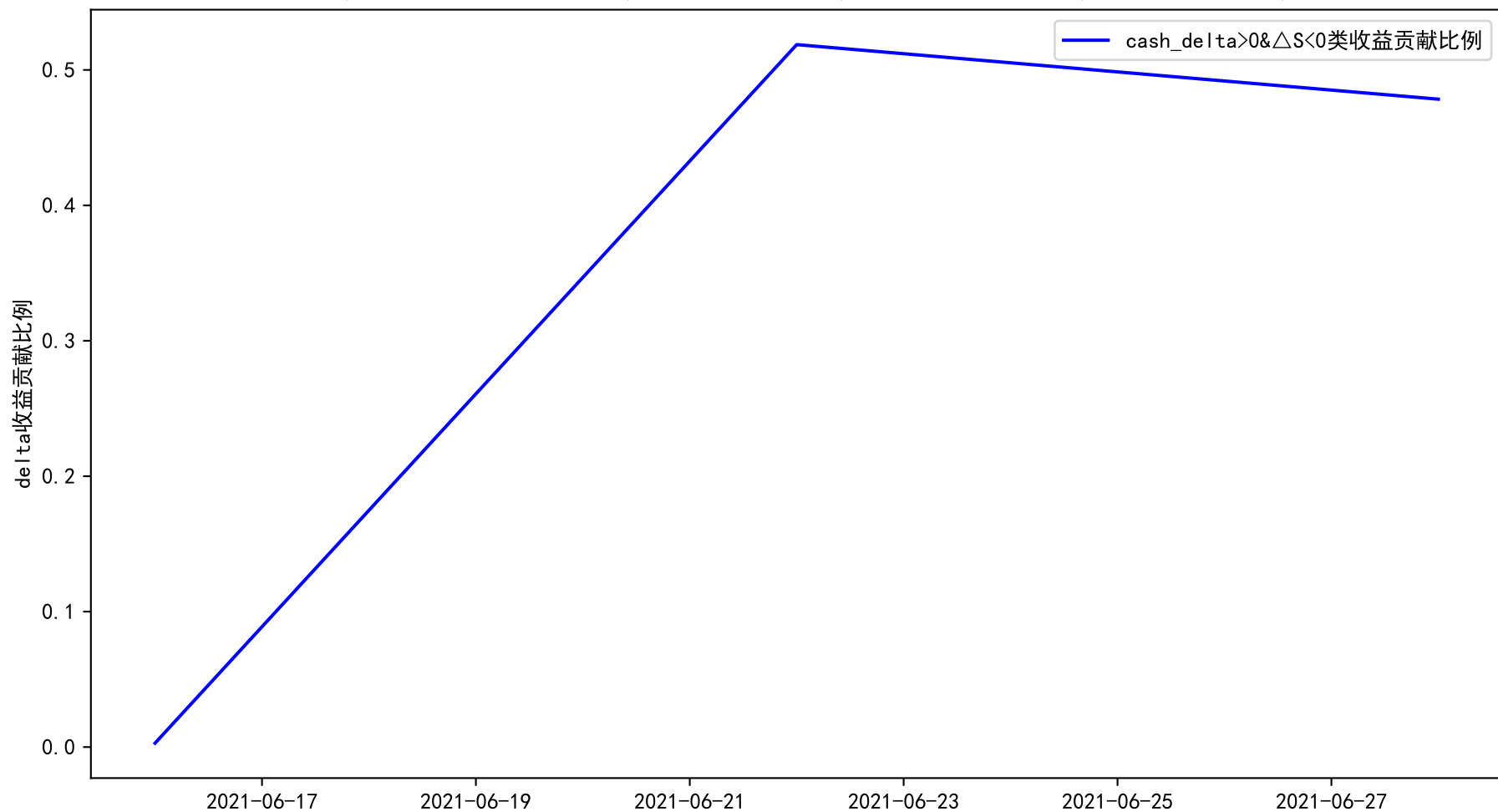
cash_delta<0& Δ S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



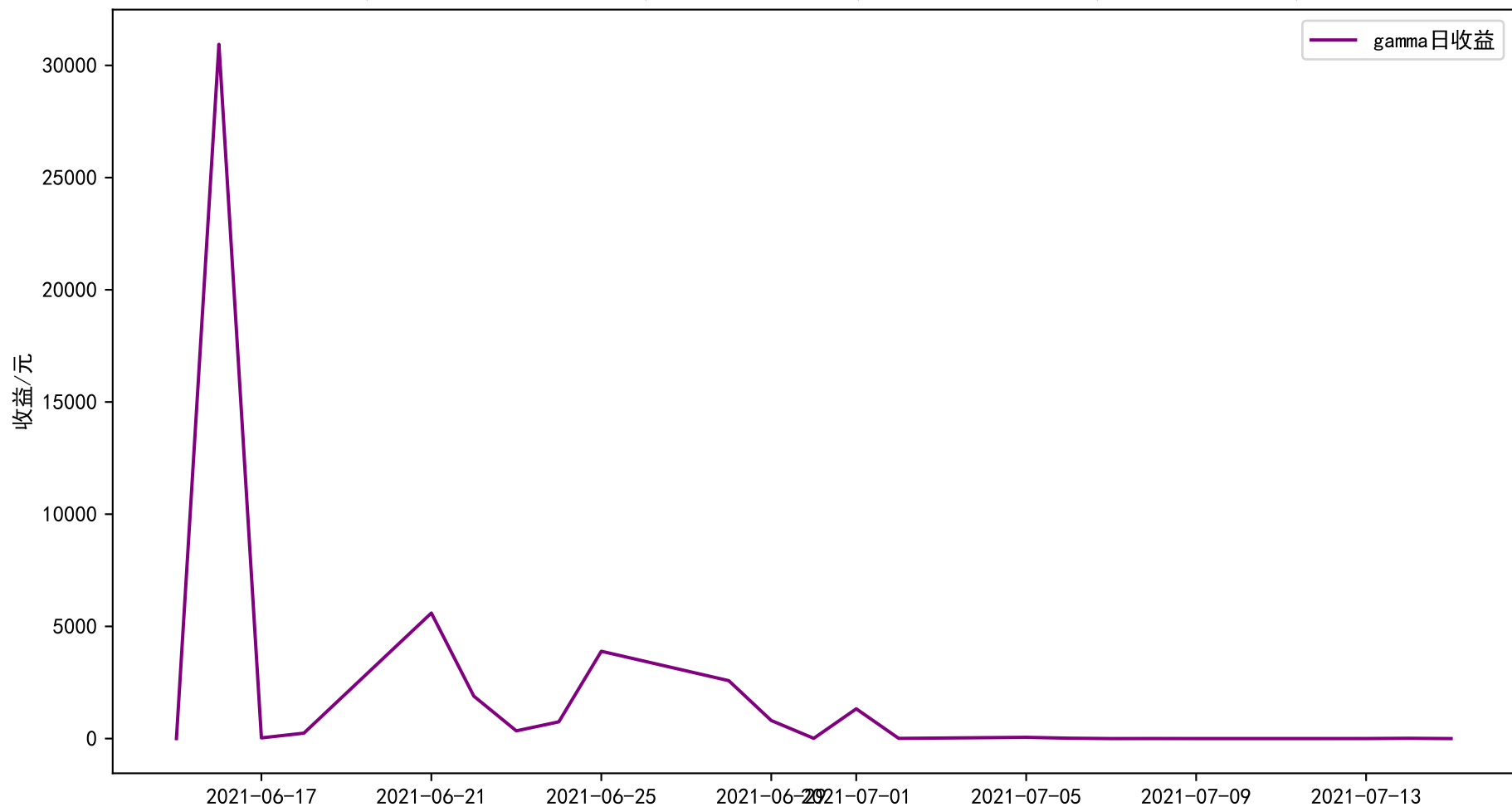
cash_delta>0&△S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



gamma日收益, 对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差, 名义金额:20,000,000, 标的:300180.SZ, 期权费:5,776,000, 低执行价:3.68, 高执行价:5.79



其他日收益，对冲策略:HedgeHalf

期权类型:看涨价差，名义金额:20,000,000，标的:300180.SZ，期权费:5,776,000，低执行价:3.68，高执行价:5.79

