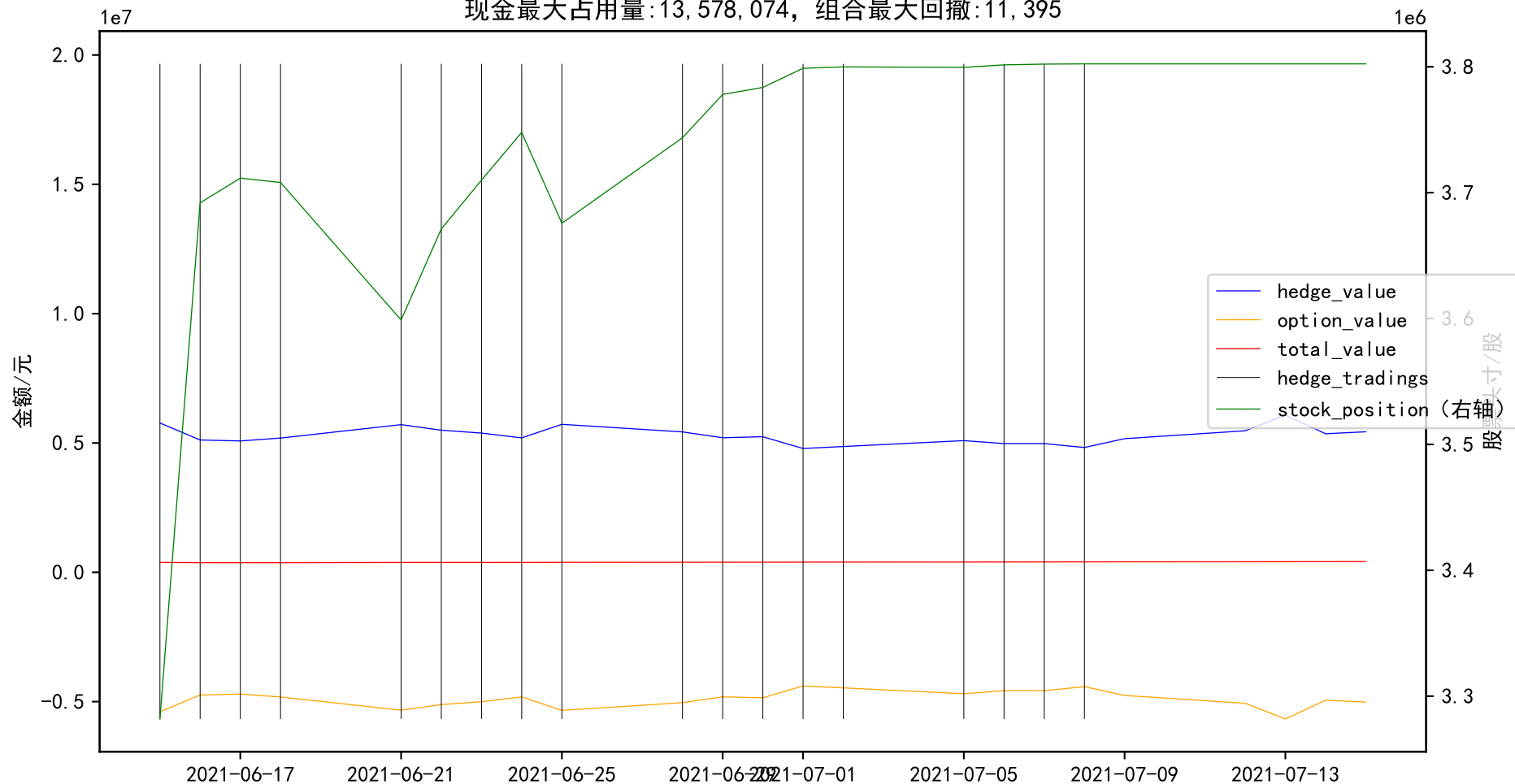


股票期权对冲总览, 对冲策略:HedgeAll

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

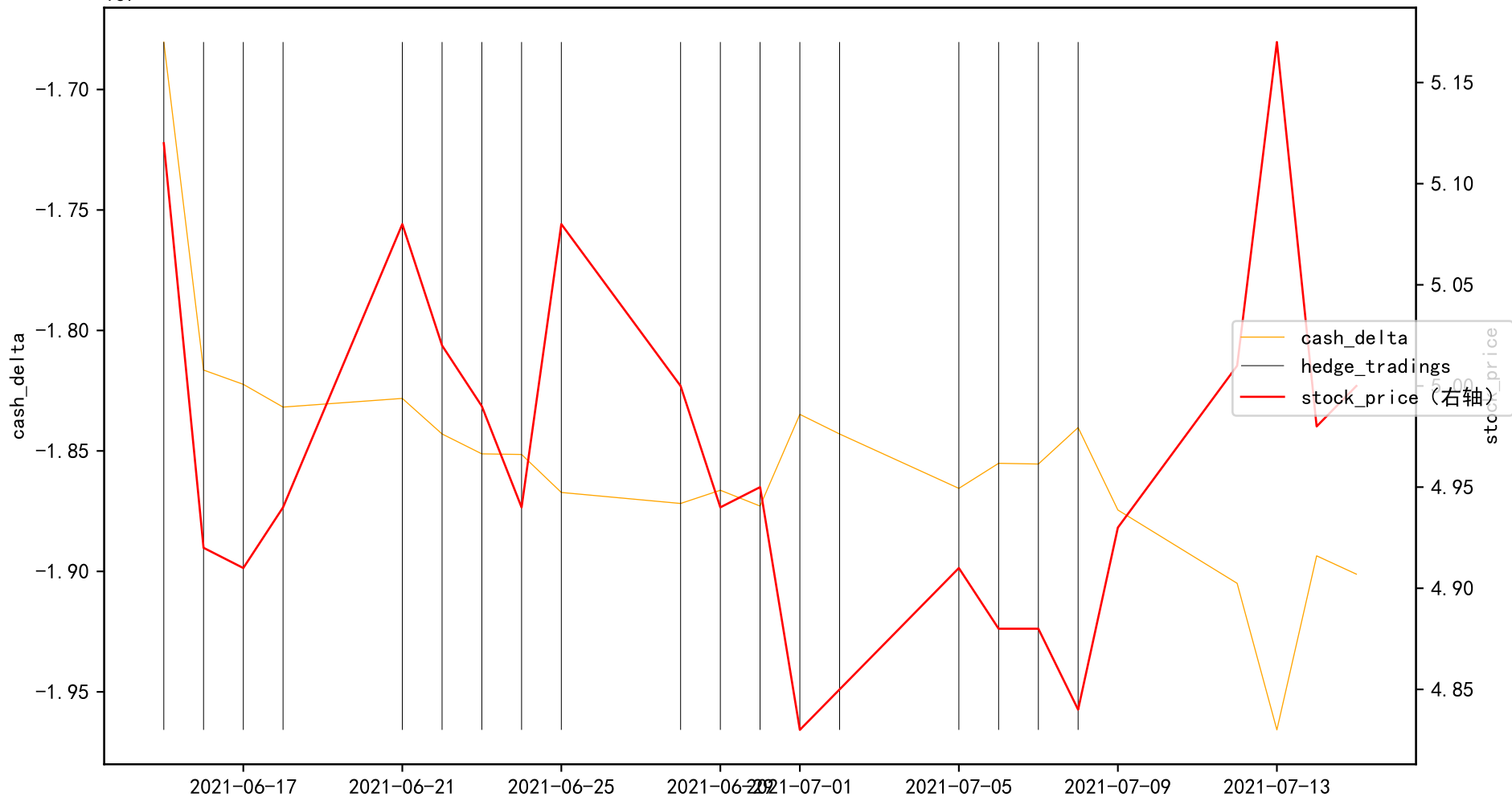
整体盈利: 414,414, 期权损益: 756,988, 对冲损益: -338,328, 交易成本: 4,246

现金最大占用量: 13,578,074, 组合最大回撤: 11,395



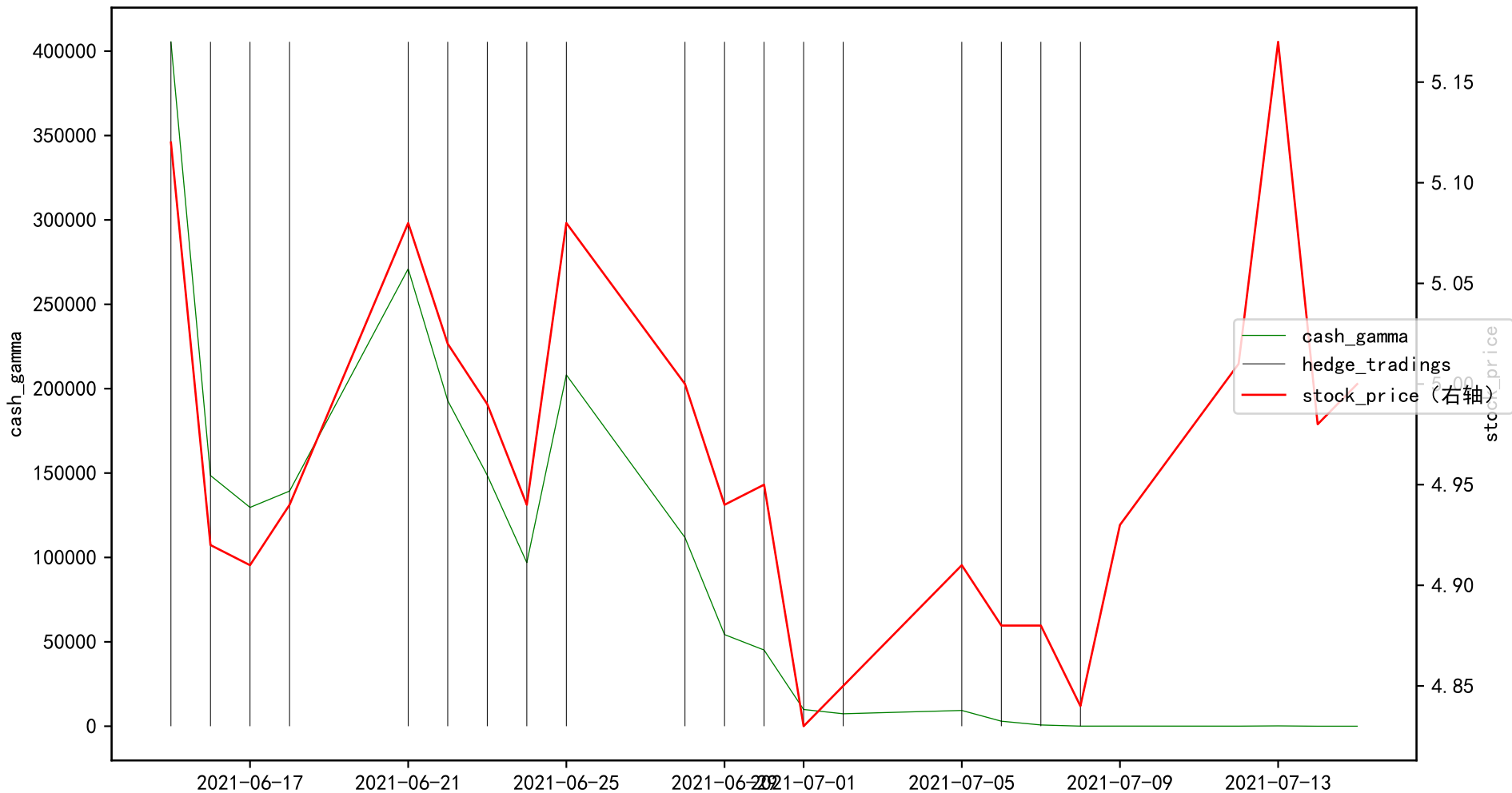
cash_delta分析, , 对冲策略:HedgeAll

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_gamma分析, , 对冲策略:HedgeAll

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

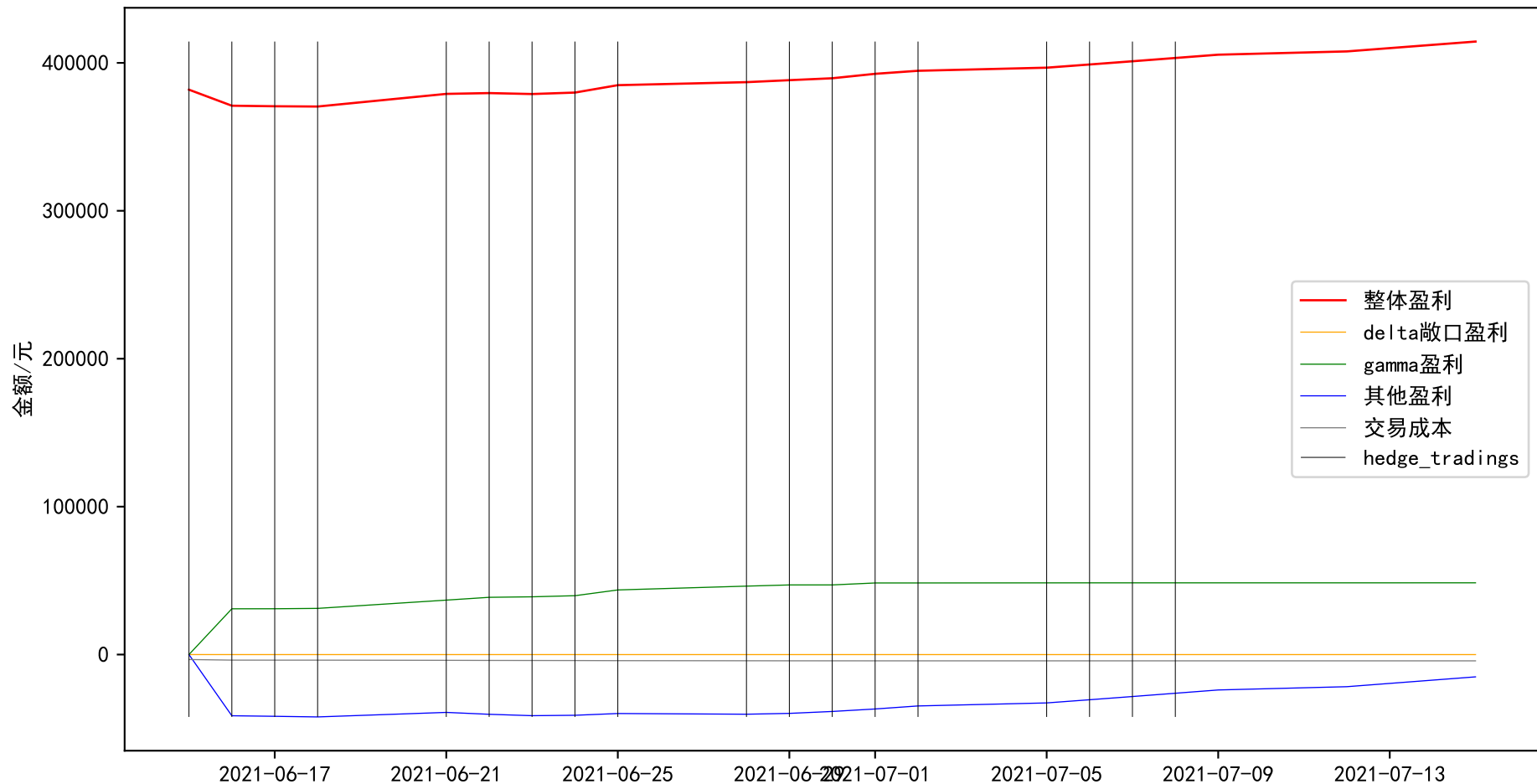


对冲收益分解, 对冲策略: HedgeAll

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: 414,414, 期权初始价值: -5,390,756, delta敞口盈利: -15, gamma盈利: 48,504

其他盈利: -15,072, 交易成本: 4,246

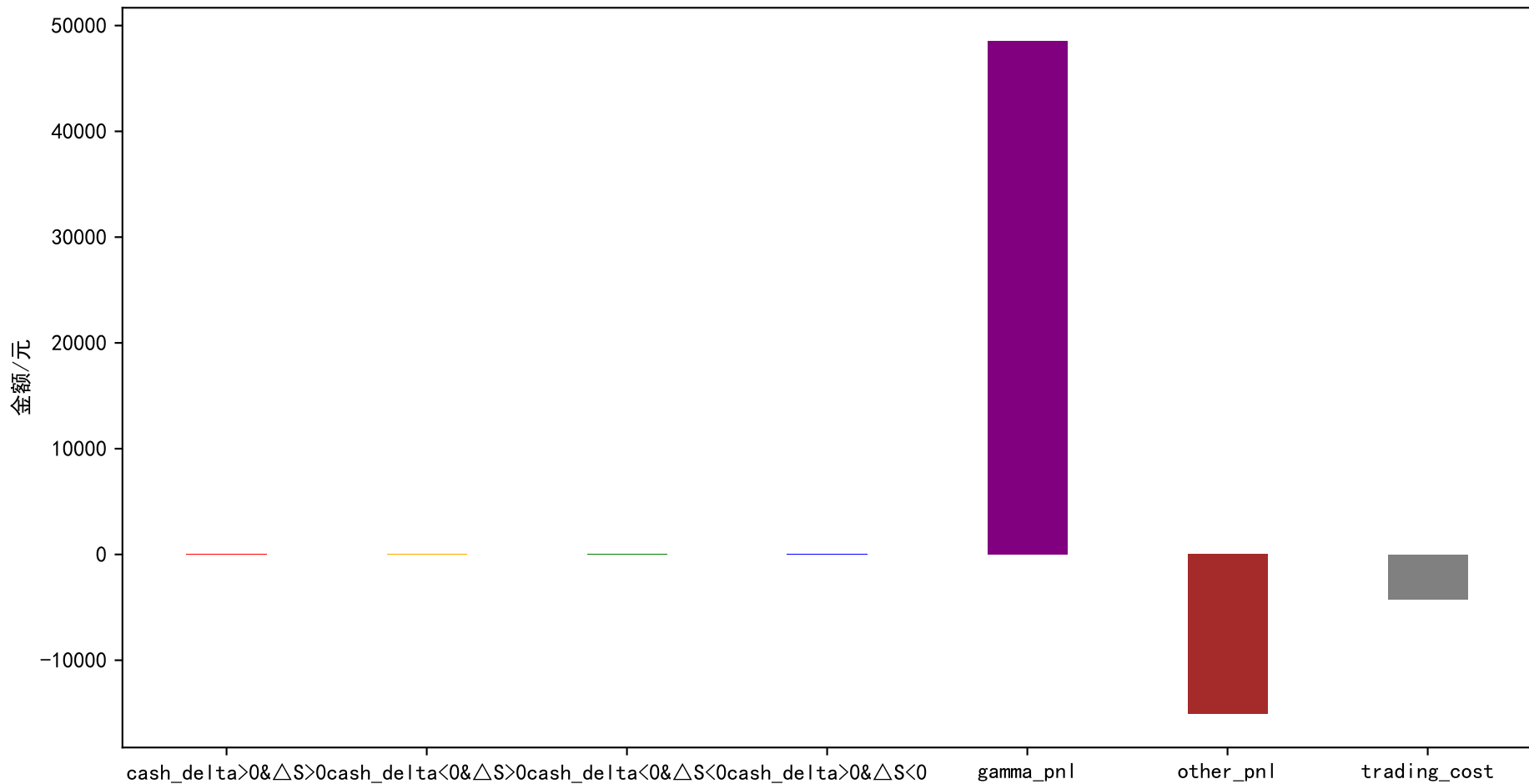


收益拆解，对冲策略:HedgeAll

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

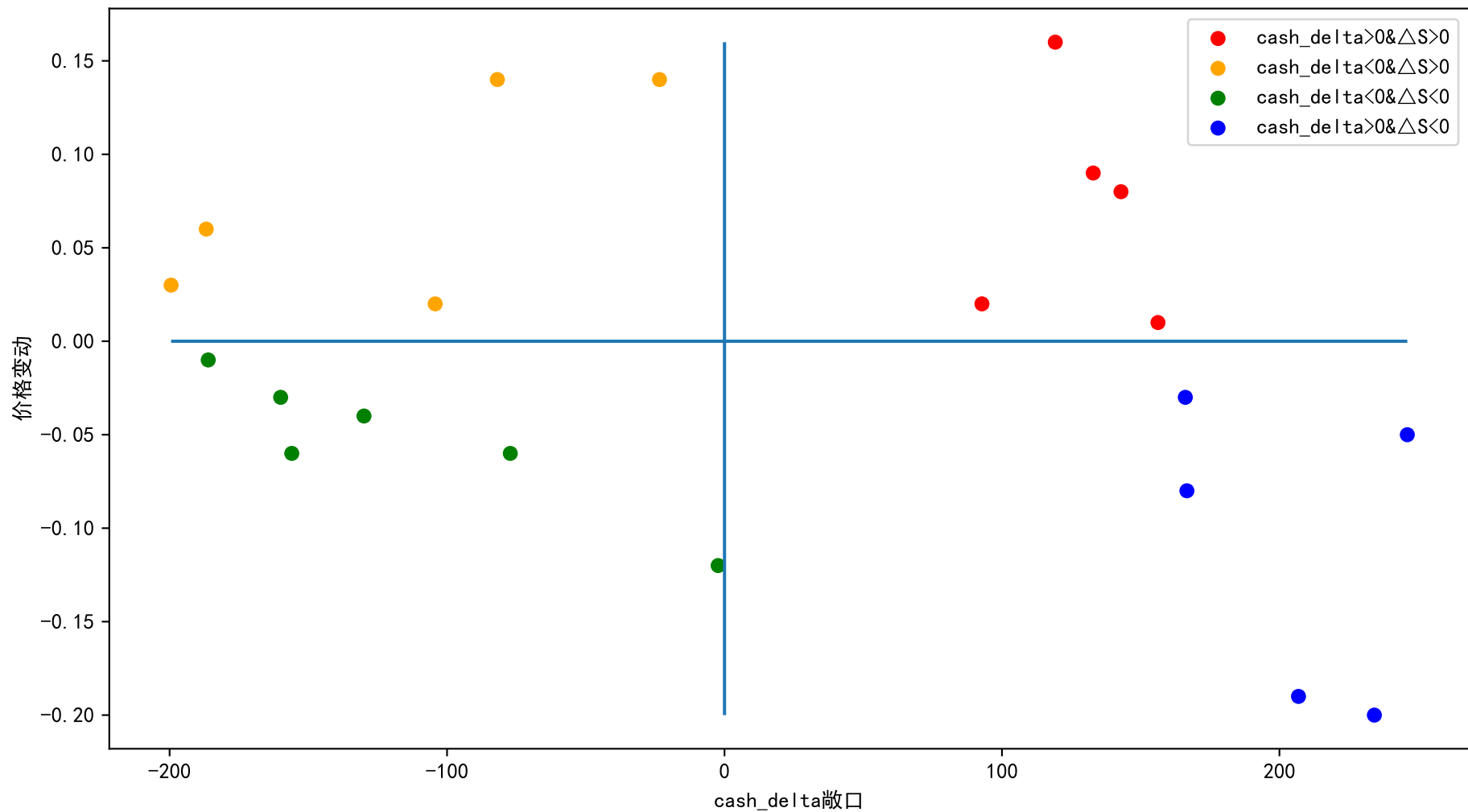
四个累计收益:9 -7 5 -23

gamma收益:48,504，其他盈利:-15,072，交易成本:4,246



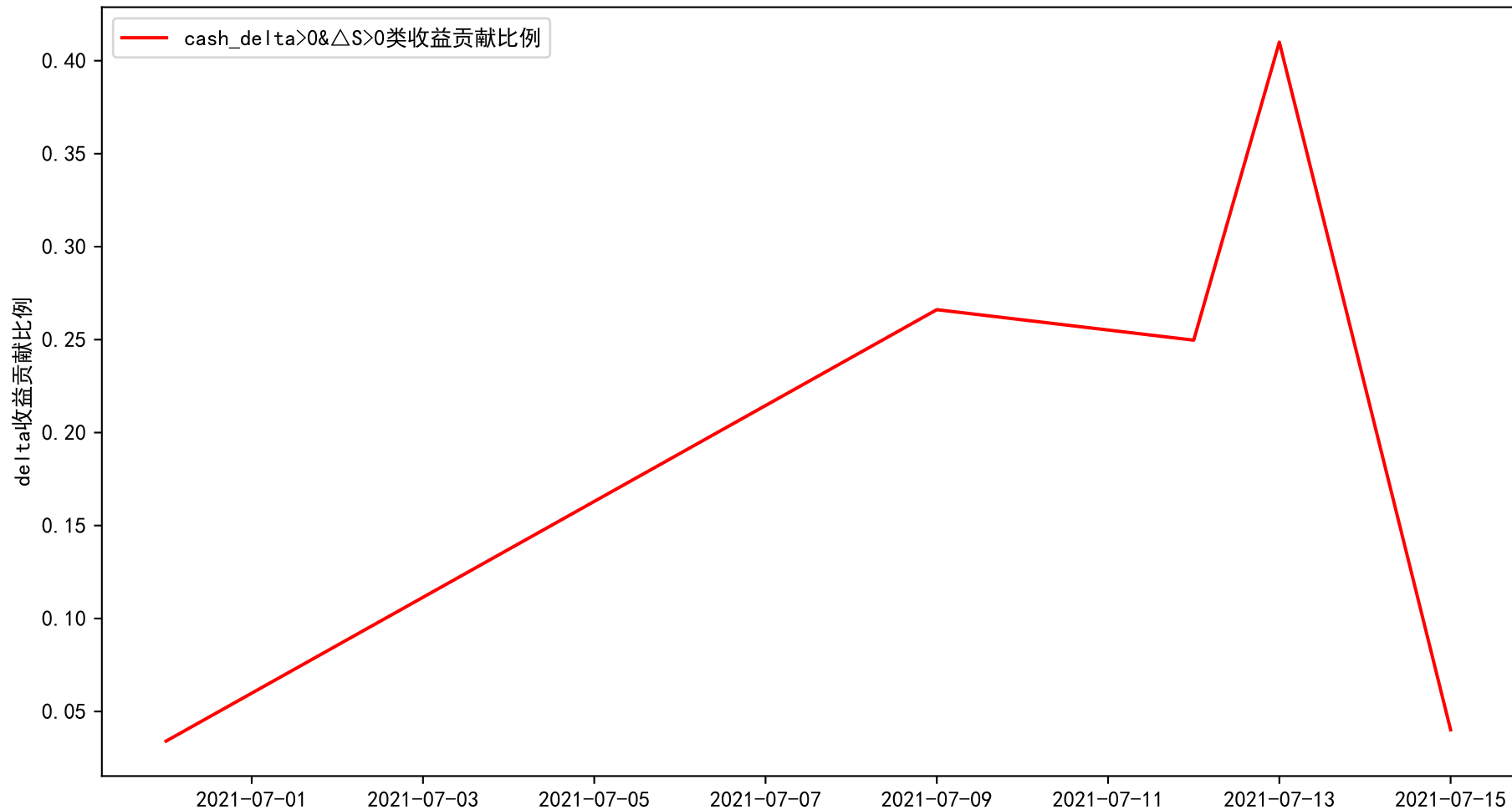
delta敞口收益散点图，对冲策略:HedgeAll

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



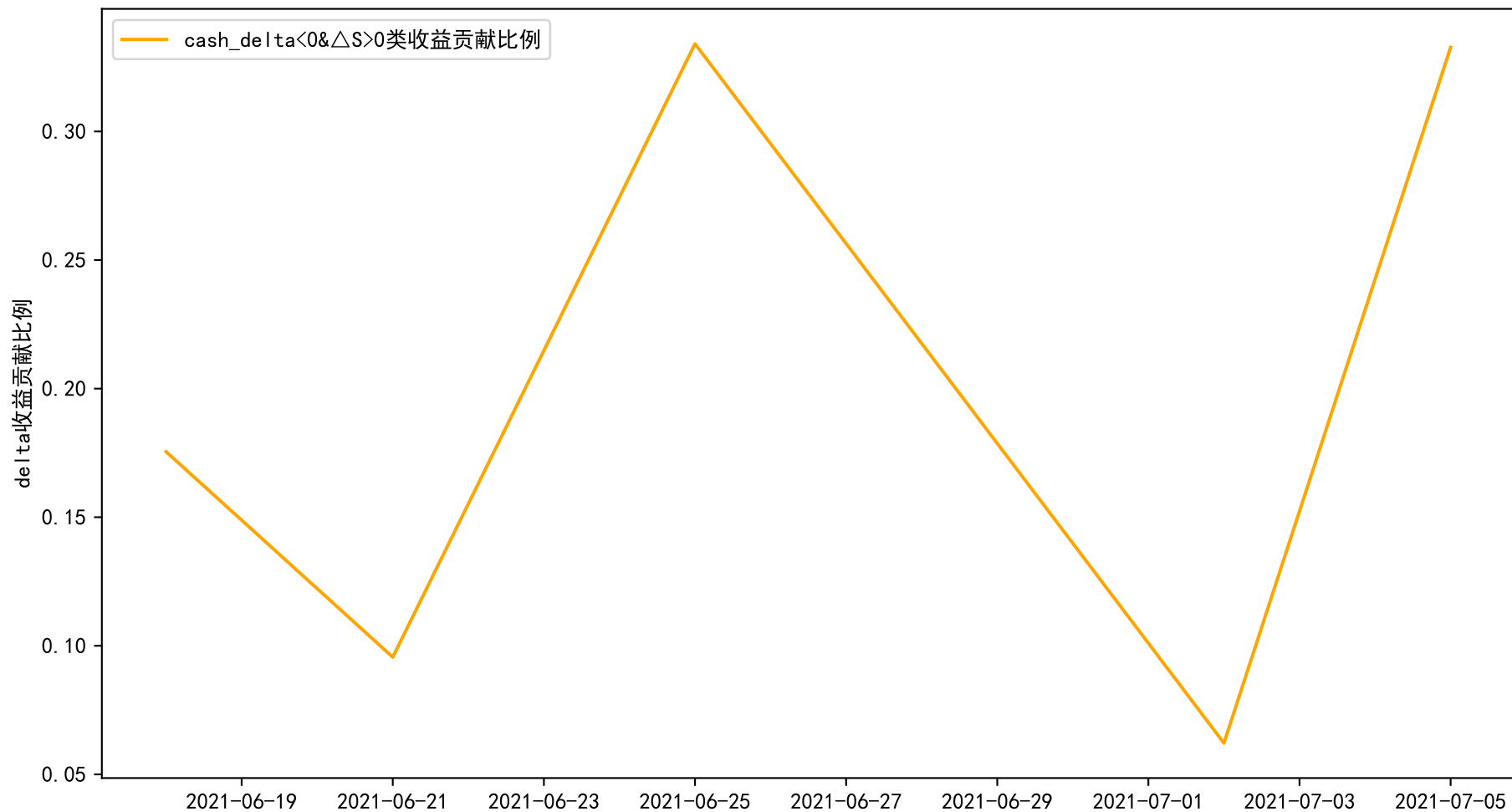
cash_delta>0& Δ S>0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

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:HedgeAll

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



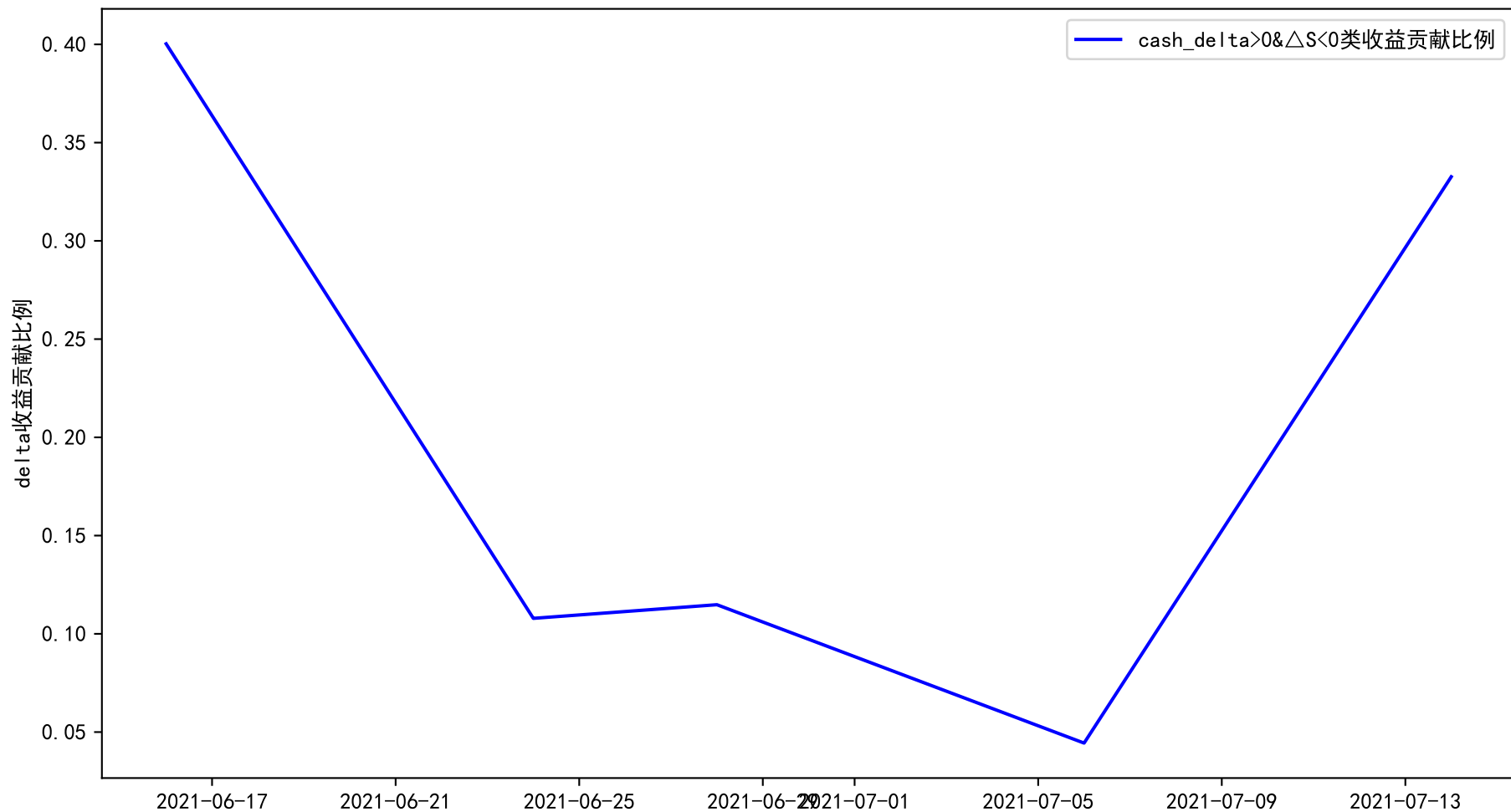
cash_delta<0&△S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

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



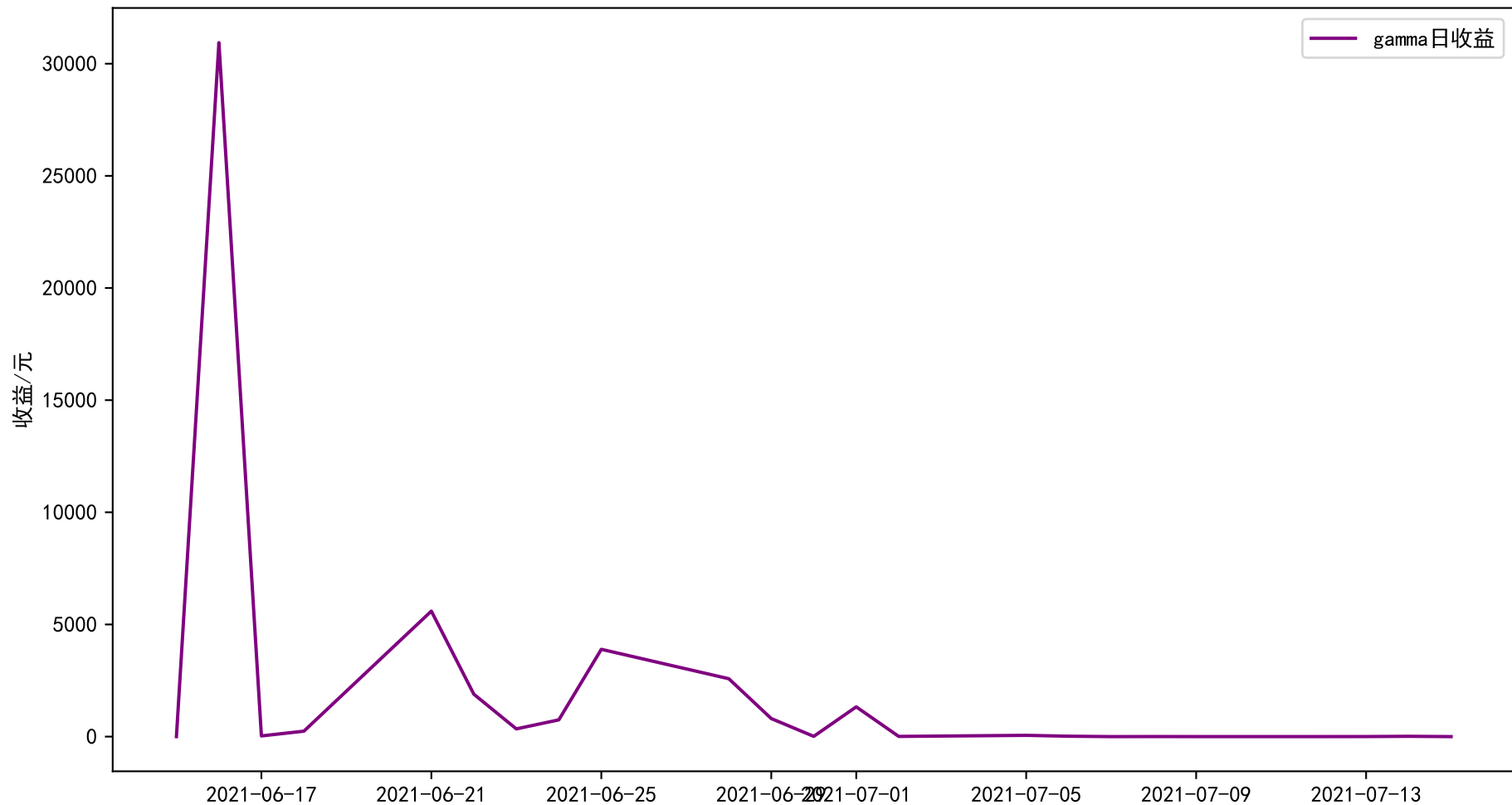
cash_delta>0& Δ S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

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:HedgeAll

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:HedgeAll

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

