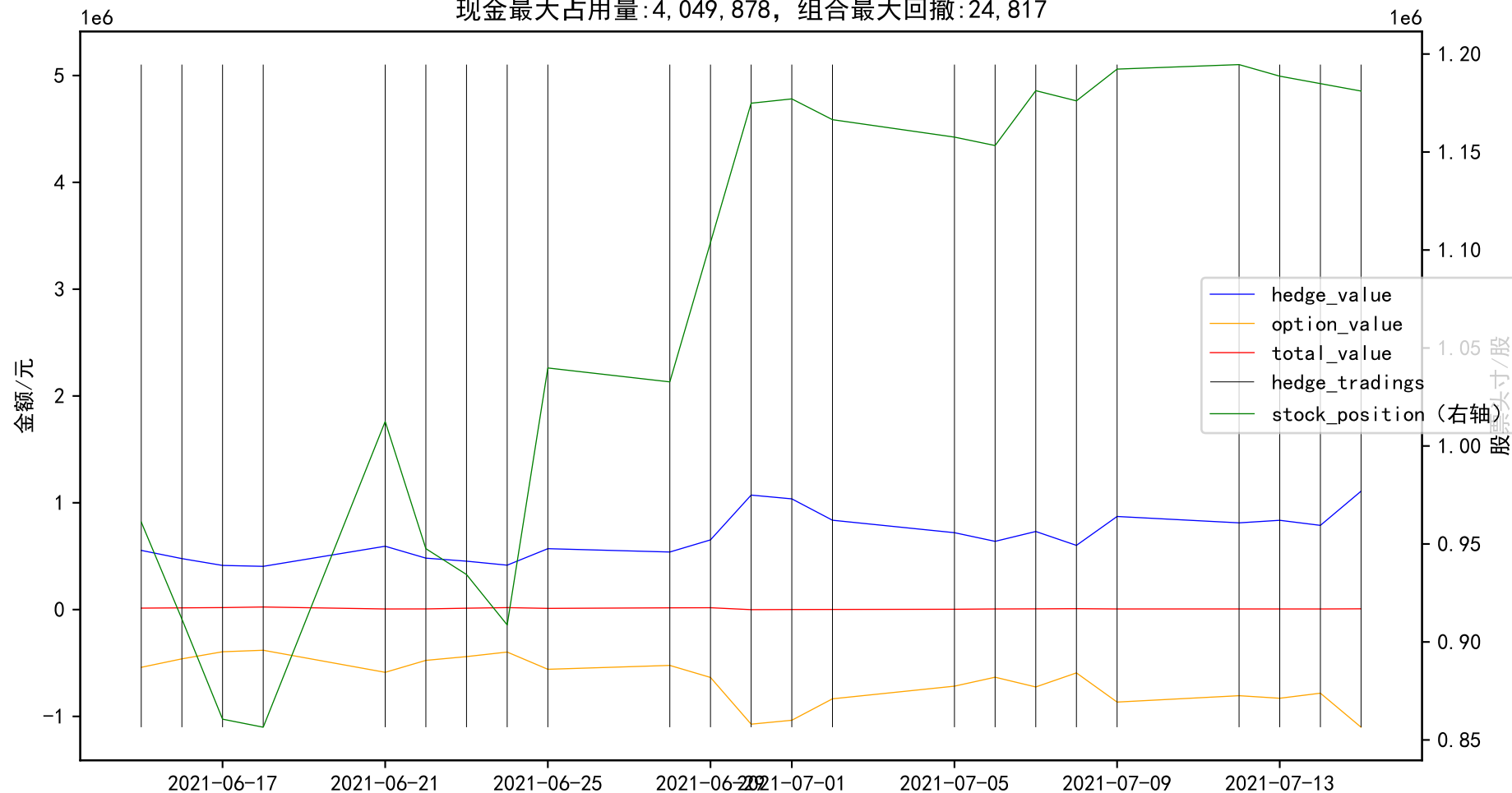


# 股票期权对冲总览, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81

整体盈利:7,350, 期权损益:-546,050, 对冲损益:554,696, 交易成本:1,296

现金最大占用量:4,049,878, 组合最大回撤:24,817

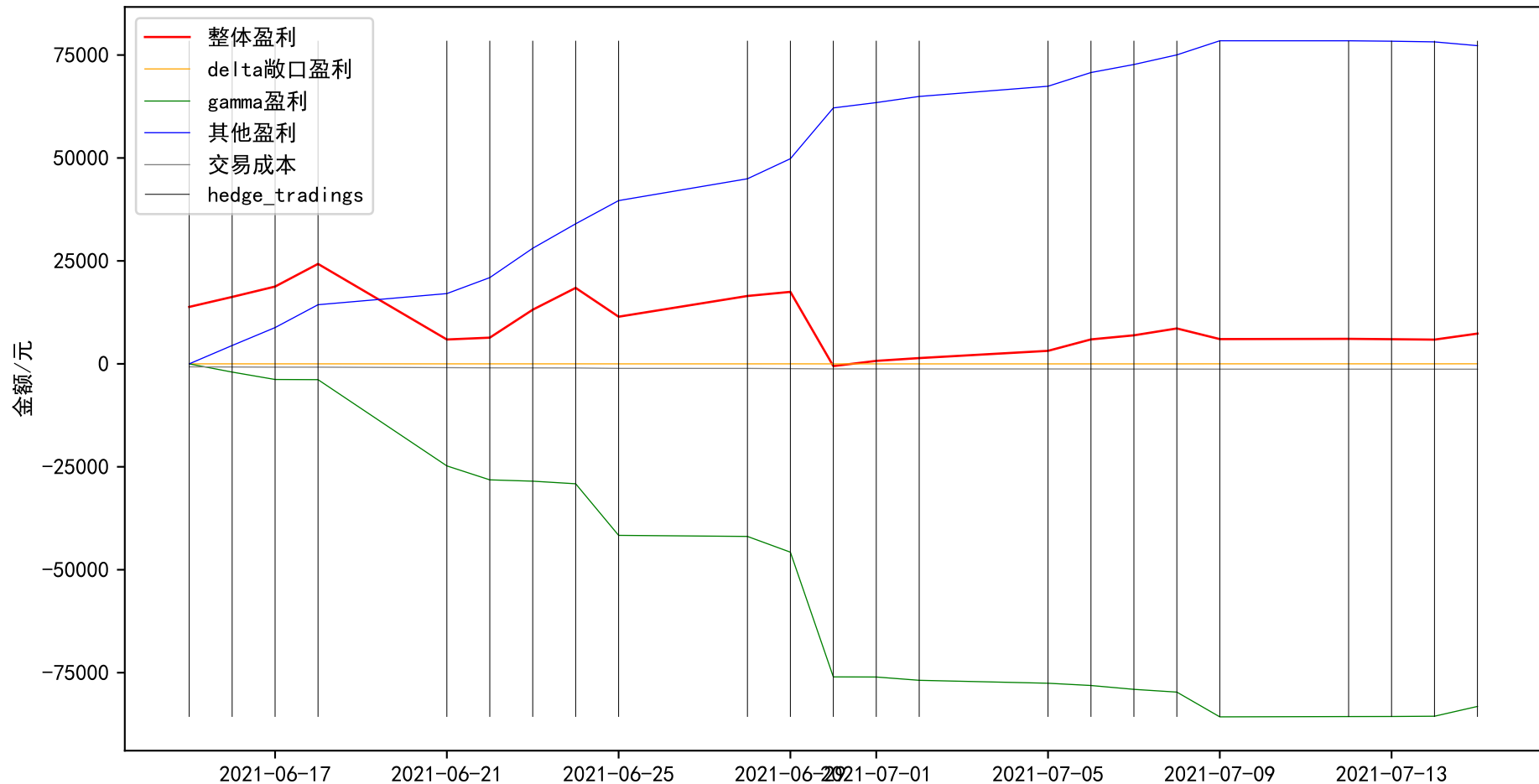


对冲收益分解, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81

整体盈利:7,350, 期权初始价值:-540,446, delta敞口盈利:16, gamma盈利:-83,196

其他盈利:77,272, 交易成本:1,296

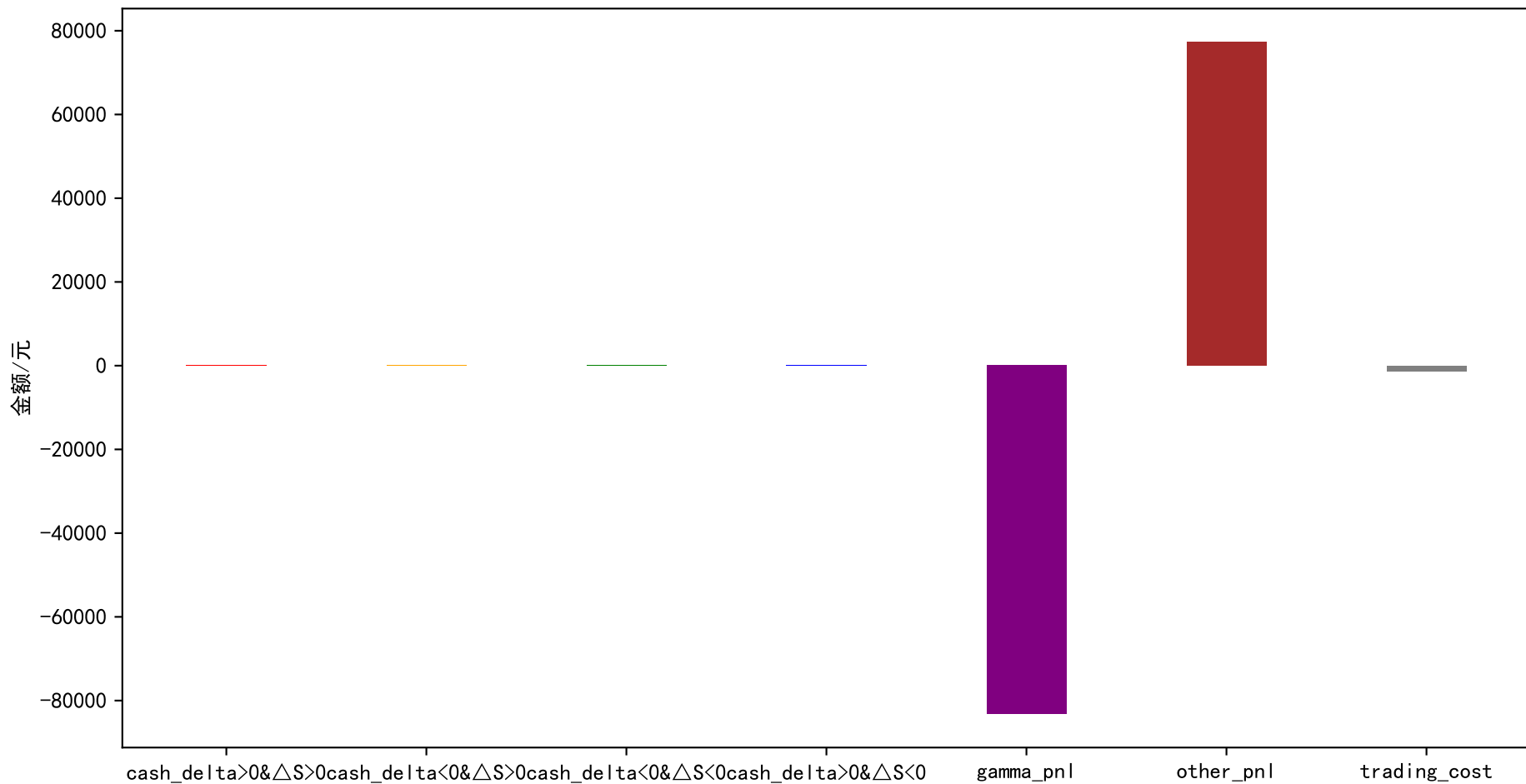


收益拆解，对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨，名义金额:5,000,000，标的:600808.SH，期权费:555,000，低执行价:3.43，高执行价:3.81

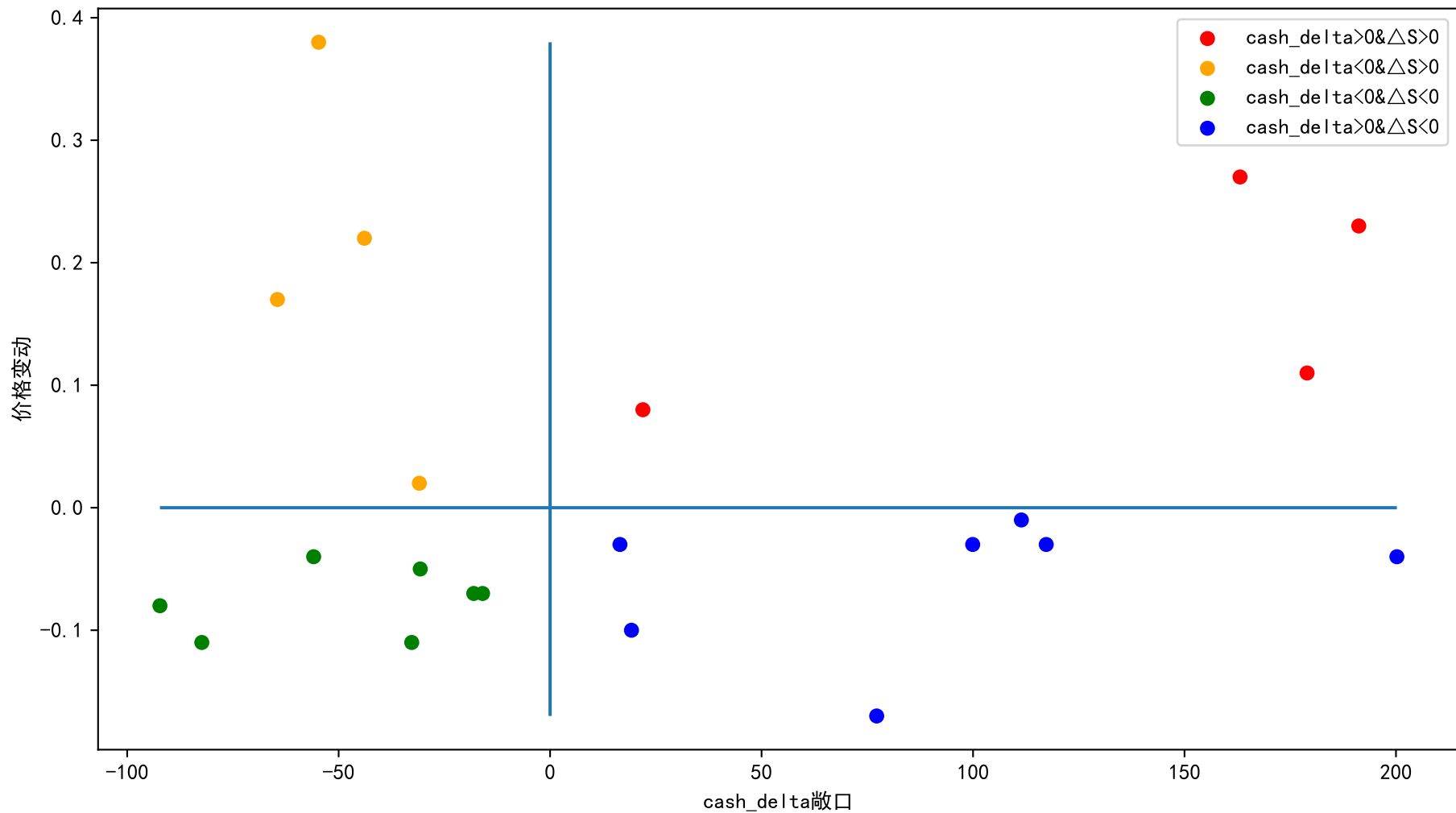
四个累计收益:28 -11 7 -8

gamma收益:-83,196，其他盈利:77,272，交易成本:1,296



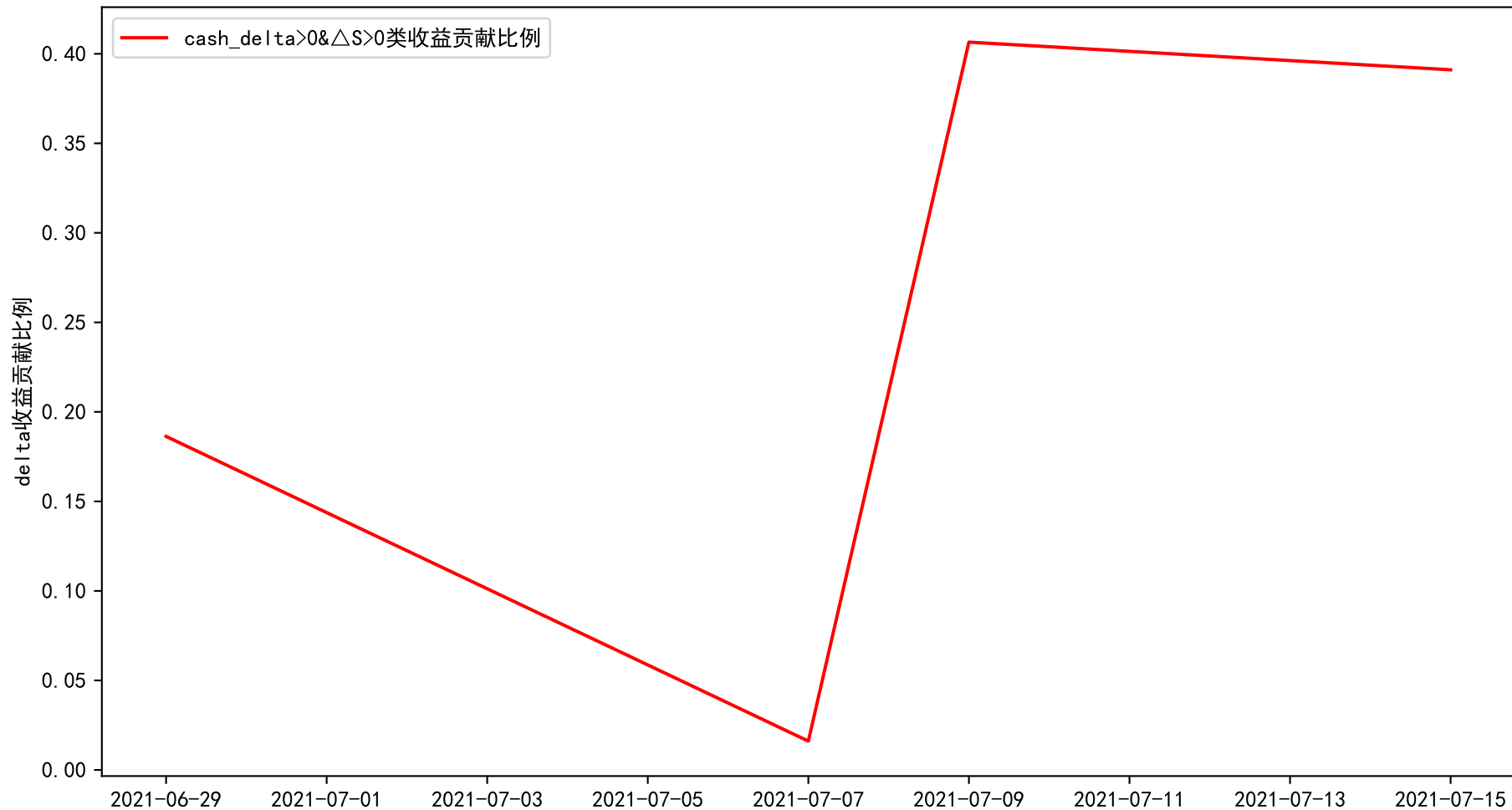
delta敞口收益散点图, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81



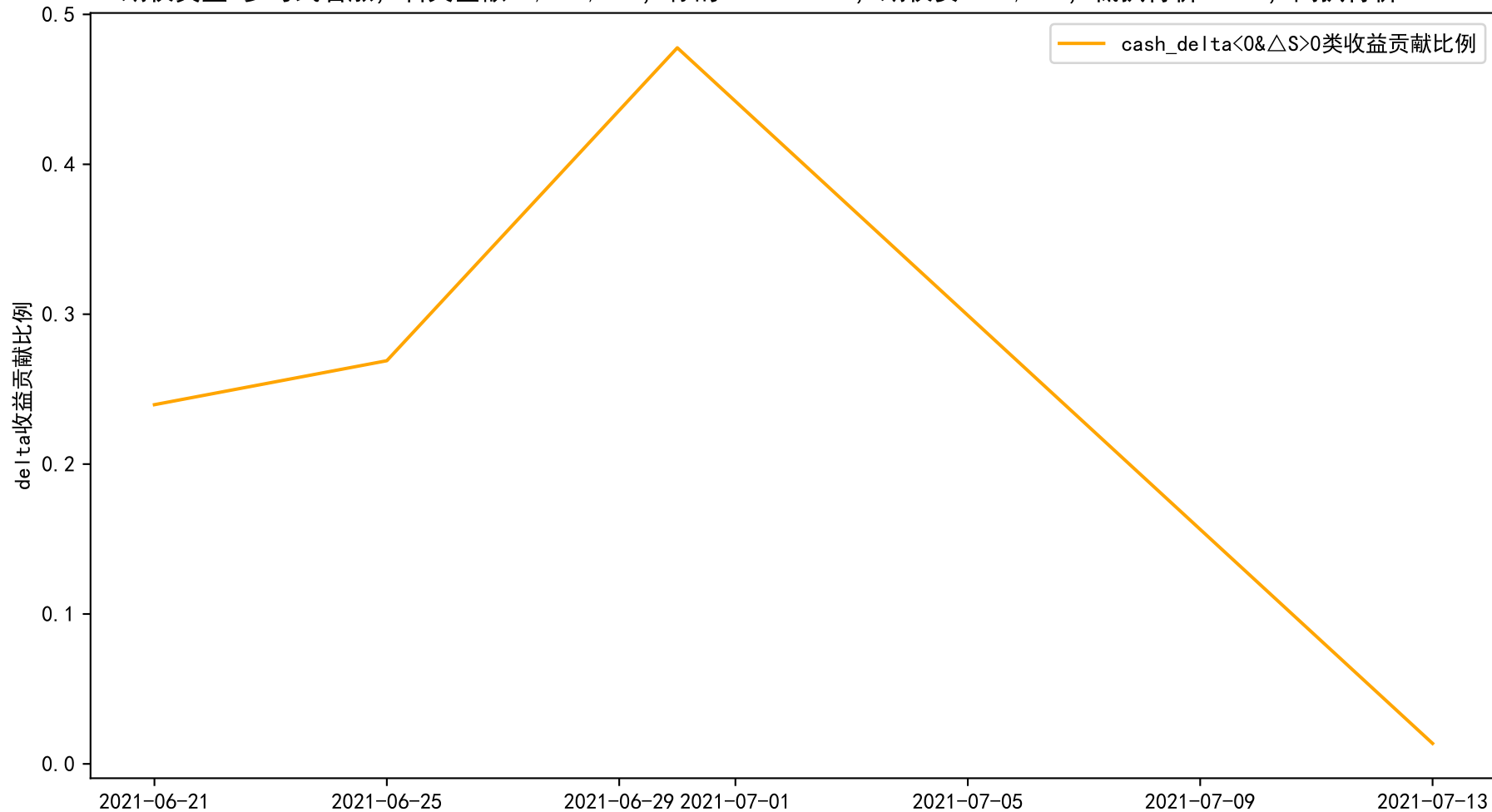
cash\_delta>0& $\Delta$ S>0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81



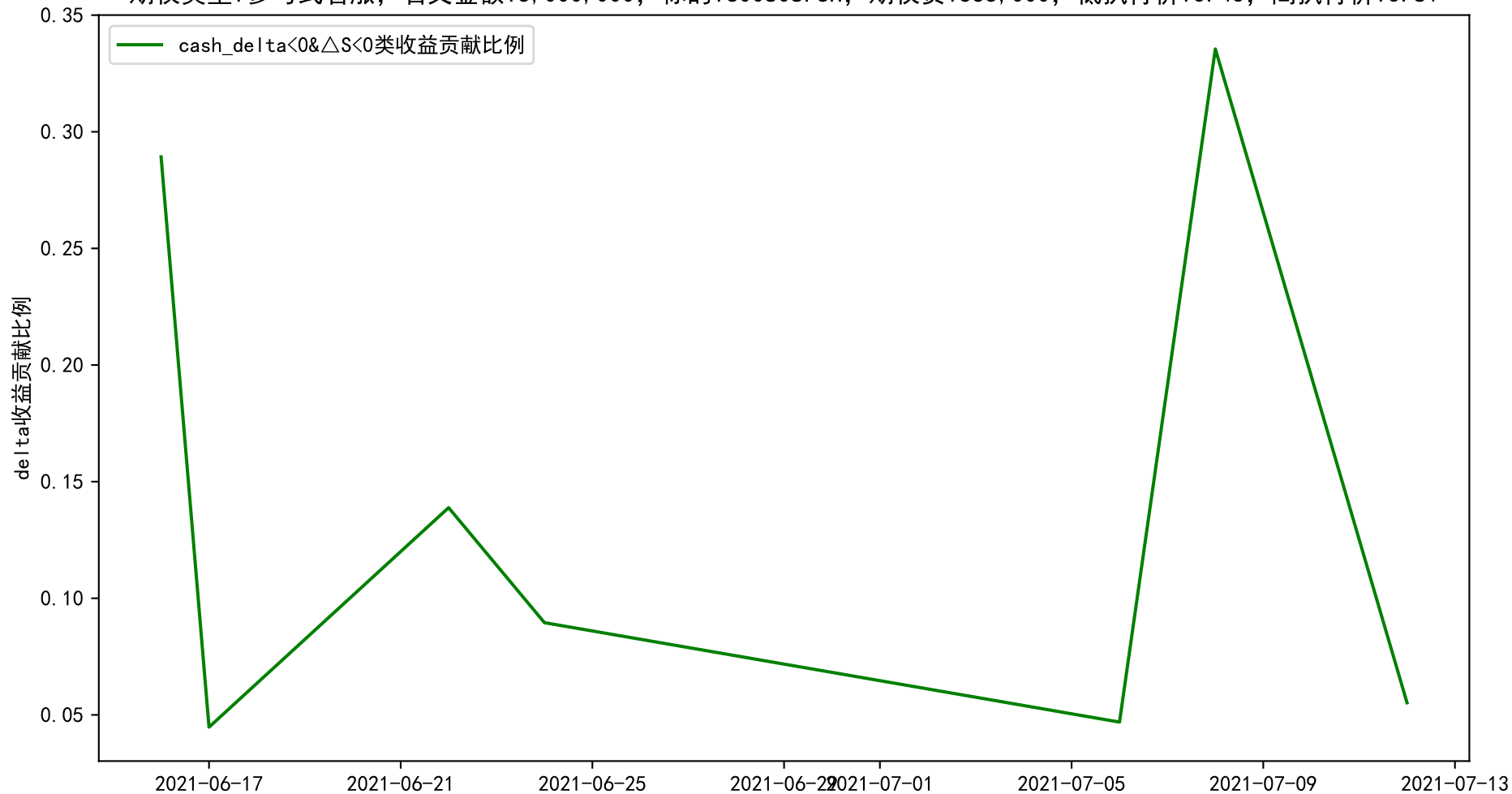
cash\_delta<0&△S>0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81



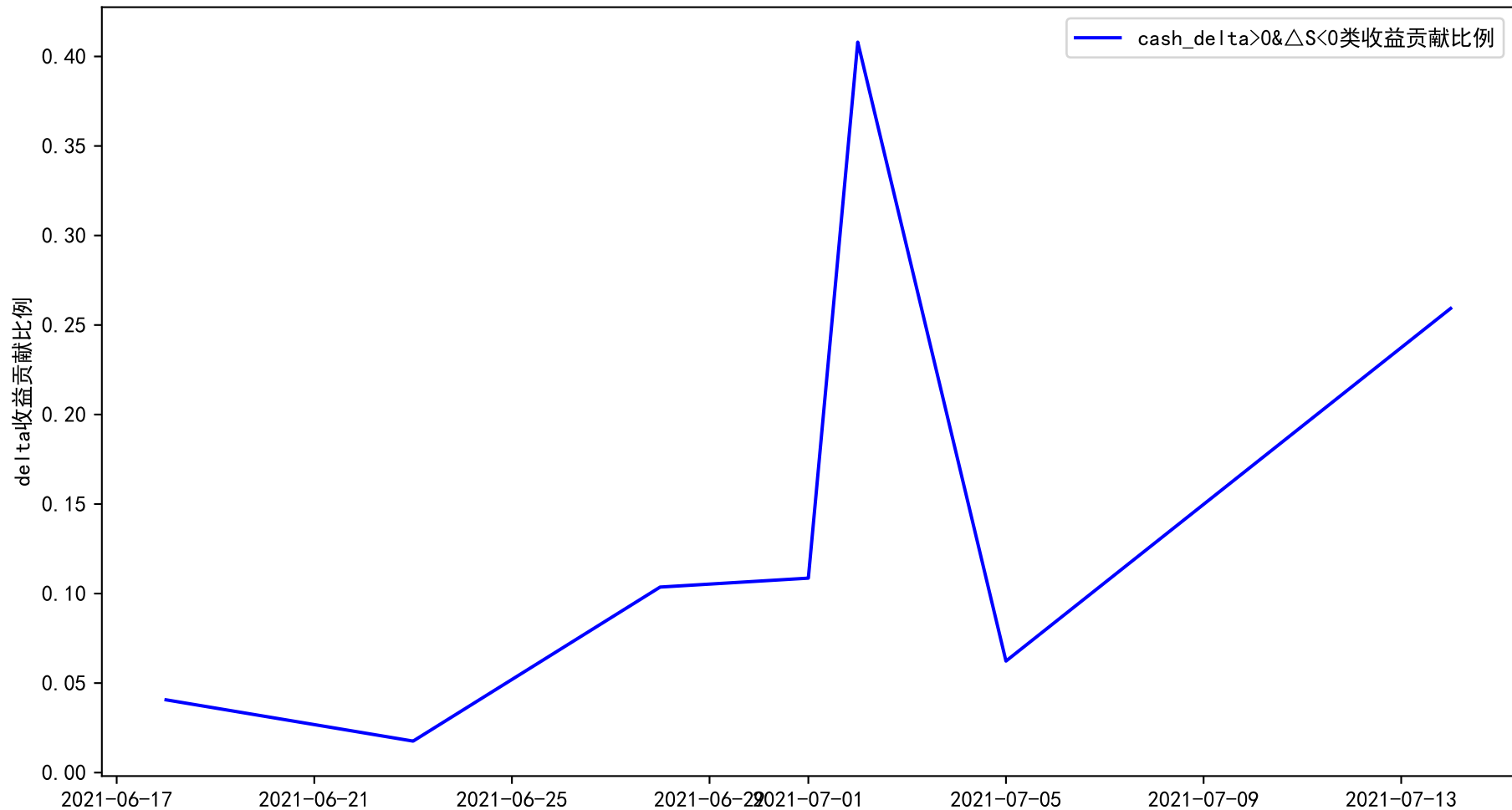
cash\_delta<0& $\Delta$ S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81



cash\_delta>0& $\Delta$ S<0类收益贡献比例分析, 对冲策略:HedgeAll

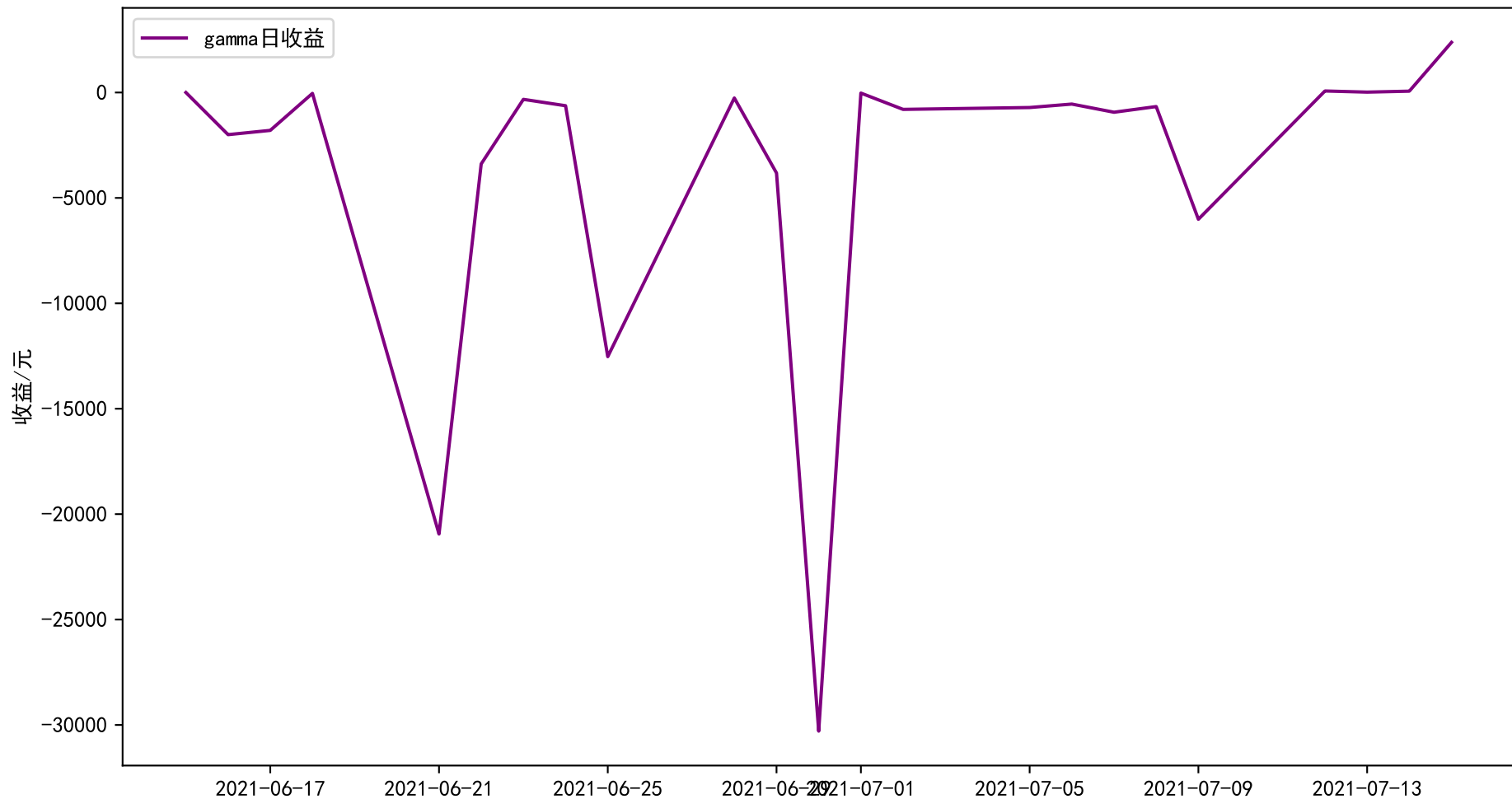
期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81





gamma日收益, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81



其他日收益, 对冲策略:HedgeAll

期权类型:参与式看涨, 名义金额:5,000,000, 标的:600808.SH, 期权费:555,000, 低执行价:3.43, 高执行价:3.81

