

期权对冲回测报告

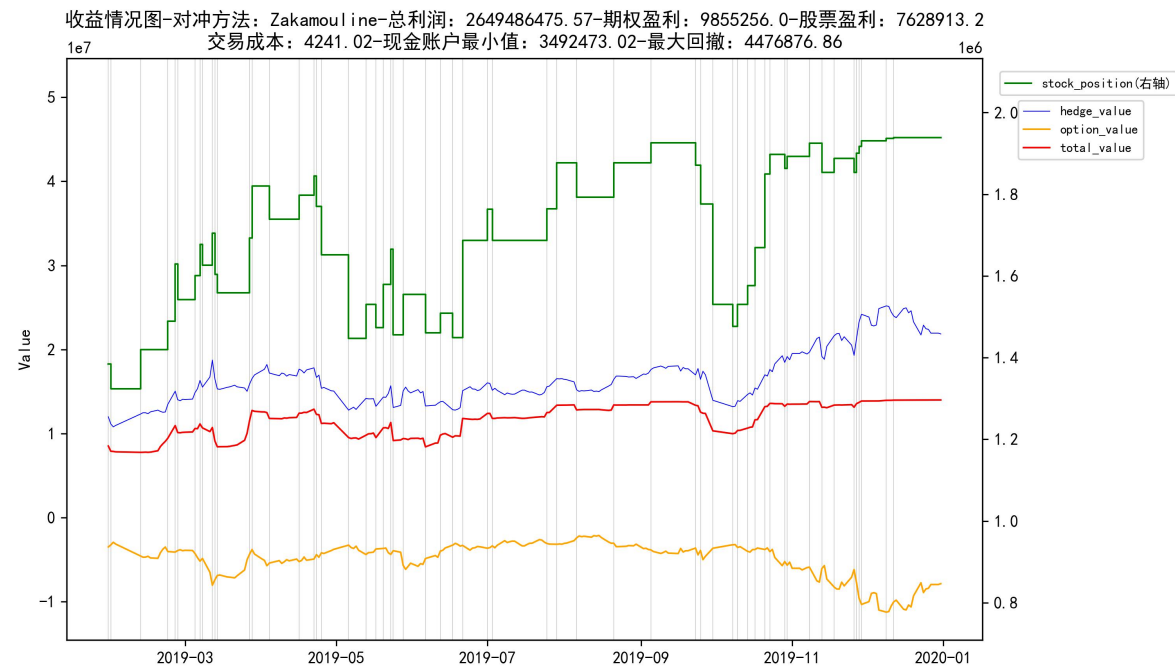
1. 参数详情

参数名称	参数数值
期权类型	VanillaCall
名义金额	12000000.0
发行日期	20190129
行权日期	20191231
标的股票	300277.SZ
标的价格	6.19
对冲策略	Zakamouline

2. 回测结果

2.1 股票对冲回测

总损益	股票损益	期权损益	交易成本	最小现金账户	最大回撤
2649486475.57	9855256.0	7628913.2	4241.02	3492473.02	4476876.86



2.2 对冲收益分解

gamma	vega	theta	高阶项	未对冲损益	交易成本	总损益
836360.41	463171.69	-1153697.77	-2739709.04	16820217.57	4241.02	2649486475.57

收益分解图-对冲方法: Zakamouline-总利润: 2649486475.57-gamma: 836360.41-theta: -1153697.77
vega: 463171.69-高阶: -2739709.04-未对冲损益: 16820217.57-交易成本: 4241.02

