

期权对冲回测报告

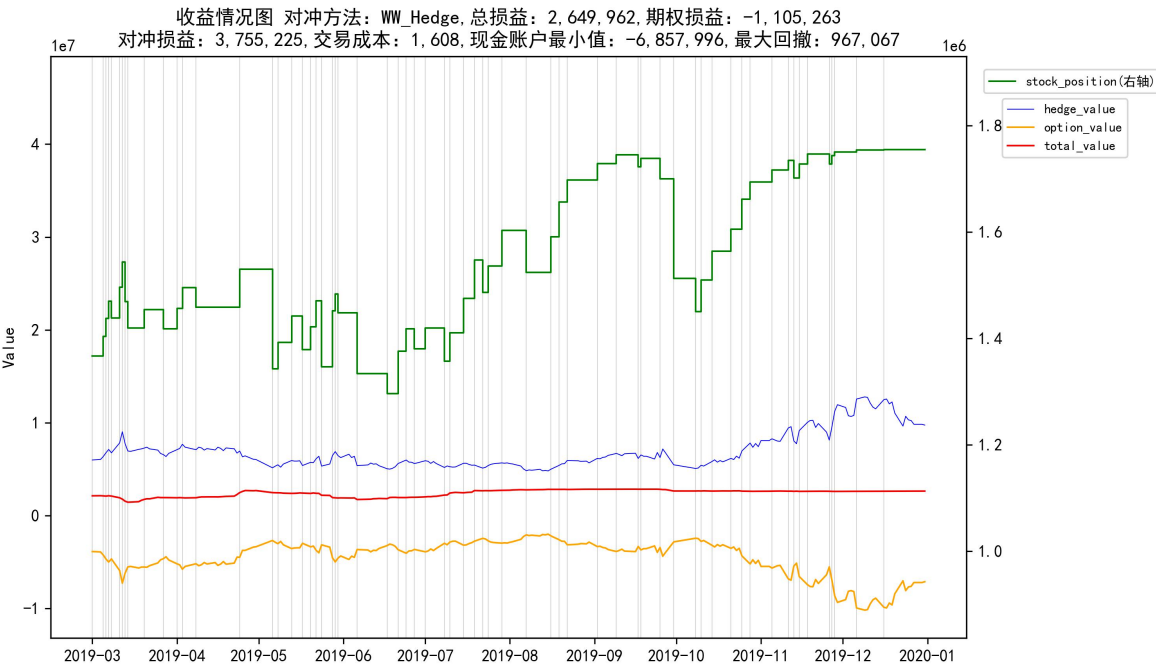
1. 参数详情

参数名称	参数数值
期权类型	VanillaCall
名义金额	12000000.0
发行日期	20190301
行权日期	20191231
标的股票	300277.SZ
标的价格	6.84
对冲策略	WW_Hedge

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
2649962.15	-1105263.31	3755225.46	1607.55	-6857995.54	967067.14



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
686982.6	-415786.63	-924245.0	145820.52	7511191.73	1607.55	503523114.7

收益分解图-对冲方法: WW_Hedge-总利润: 503523114.7-gamma: 686982.6-theta: -924245.0
vega: -415786.63-高阶: 145820.52-未对冲损益: 7511191.73-交易成本: 1607.55

