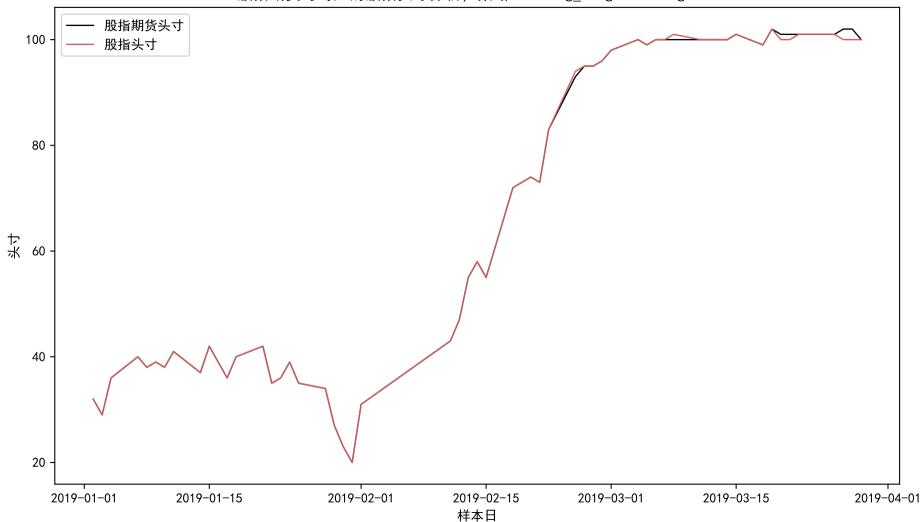


股指期货与对应的股指头寸分析,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll



交易成本分析,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 0.4bp -动态对冲交易成本/名义本金 展仓交易成本/名义本金 0.35bp -0. 3bp -0. 15bp -0. 1bp -0.05bp -

2019-02-15

样本日

2019-03-01

2019-02-01

2019-03-15

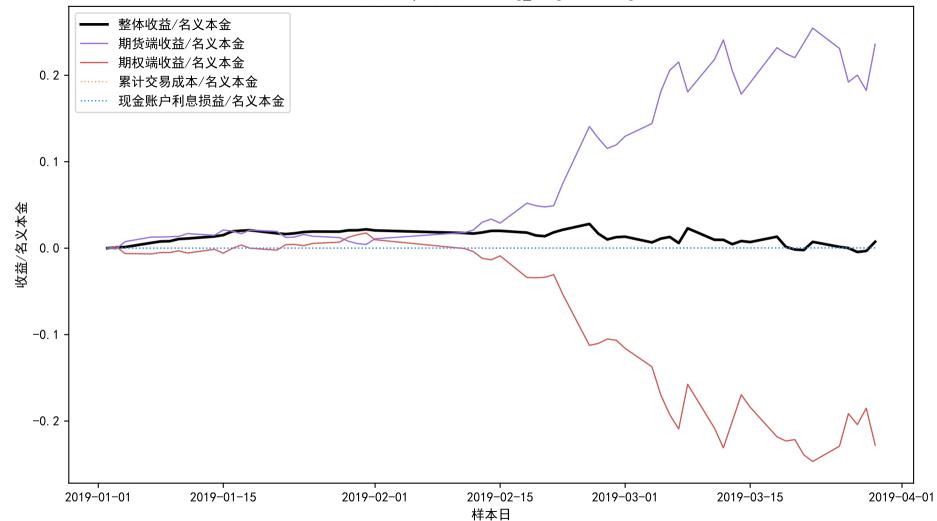
2019-04-01

0. 0bp

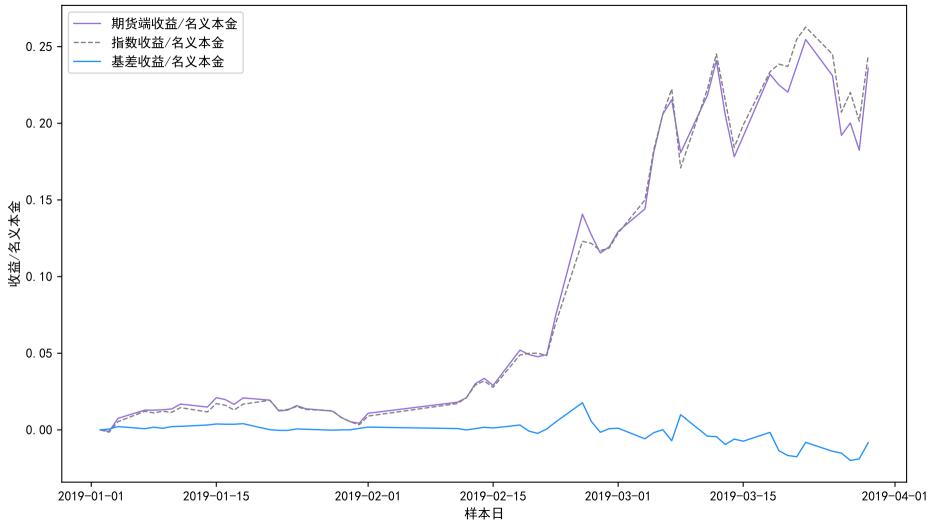
2019-01-01

2019-01-15

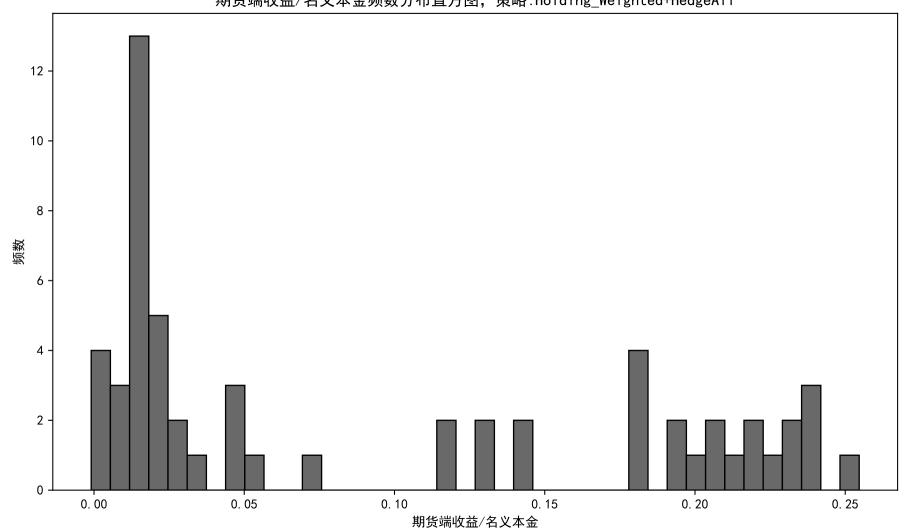
总体收益分解,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll



期货端收益分解,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll



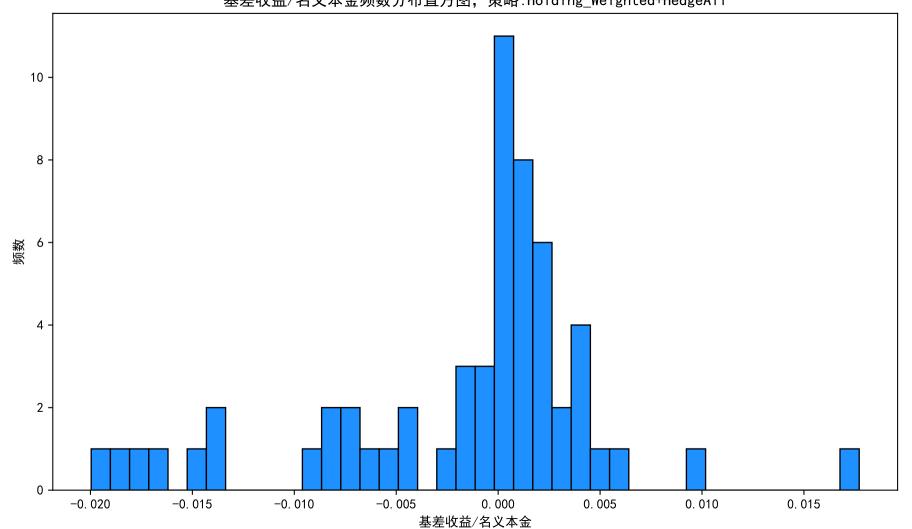
期货端收益/名义本金频数分布直方图,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll



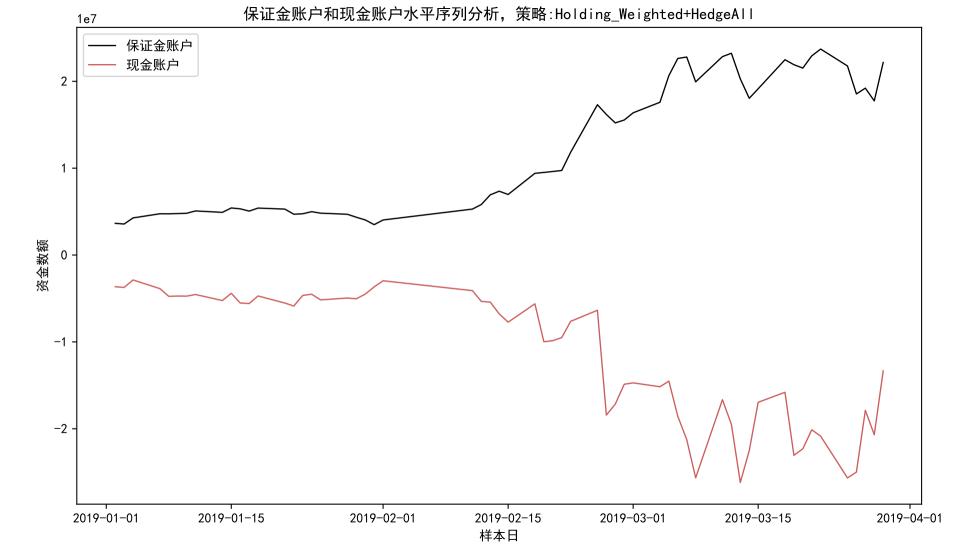
期权端收益/名义本金频数分布直方图,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 10 -8 -6 -频数 4 -2 -0 --0. 04 -0. 02 0. 00 0. 02 0. 04 -0. 06 期权端收益/名义本金

指数收益/名义本金频数分布直方图, 策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 12 -10 -8 -频数 6 4 -2 -0 · 0. 00 0. 05 0. 10 0. 20 0. 25 0. 15 指数收益/名义本金

基差收益/名义本金频数分布直方图, 策略:Holding\_Weighted+HedgeAll



交易成本/名义本金频数分布直方图, 策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 30 -25 -20 -频数 15 10 -5 -0 4. 0 1e-5 1.5 2. 5 3. 0 0.0 0. 5 1. 0 2. 0 3. 5 交易成本/名义本金



保证金账户资金频数分布直方图, 策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 10 -8 -6 -频数 4 -2 -0 <del>↓</del> 0. 25 1. 25 1. 75 2. 00 2. 25 1. 00 1. 50 0. 75 0. 50 1e7 保证金账户资金数额

现金账户资金频数分布直方图,策略:Holding\_Weighted+HedgeAll 8 -6 -5 -発 4 -3 -2 --2. 0 -0. 5 -2. 5 **−**1. 5 **−**1. 0 1e7 现金账户资金数额

