

**股票delta是多少——假设某股票价格是10元，看涨期权的Delta为0.6，Gamma0.02，当股票价格从10元变到11元时，Delta变为（ ）-股识吧**

### 一、50etf期权的delta是什么？

Delta是衡量标的资产价格变动时，期权价格的变化幅度。

用公式表示： $\Delta = \text{期权价格变化} / \text{标的资产现货价格变化}$ 。

认购期权的Delta值为正数（范围在0和+1之间），认沽期权的Delta值为负数（范围在-1和0之间）。

可以把某只期权的Delta值（取绝对值）当做这个期权成为实值期权的概率。

实值期权的Delta较高，虚值期权的Delta较低。

以上仅供参考，具体建议您联系您所在券商客服。

**二、一个delta为0.35的股票期权(假设期权25天后到期，无风险利率为0，无红利)，对冲了股票使得delta中性，**

**三、假设某股票价格是10元，看涨期权的Delta为0.6，Gamma0.02，当股票价格从10元变到11元时，Delta变为（ ）**

假设某股票价格是10元，看涨期权的Delta为0.6，Gamma0.02，当股票价格从10元变到11元时，Delta变为0.62  $\text{Gamma} = \Delta \text{的变化} /$

期权标的物价格变化=0.02即：标的物价格变化1个点 Delta 变化0.02个点

Delta为0.6时 标的物从10元变为11元 Delta变化为 $0.6 + 0.02 = 0.62$

**四、平价期权Delta值为什么是0.5？？？？能用公式证明吗**

举例而言，某投资者考虑买入执行价格为1.2800，面值为100欧元的欧元美元看涨期

权合约。

现在市场欧元美元汇率为1.2800，该外汇期权的值为+0.5。

这就是说，如果市场欧元美元汇率涨至1.2900 - - 上涨0.01美元，那么该期权价格将上涨 $+0.5 \times 0.01 \times 100 = 0.5$ 美元

## 五、什么是Delta中性策略

展开全部我觉得应该是卖出800股股票。

股票的Delta一定是1，所以持有股票10000股，Delta就是 $10000 \times 1 = 10000$ ，如果要Delta中性的话，卖出的期权的Delta就必须也是10000（因为是卖出所以实际上有一个负号）。

因为一股期权的Delta是0.5，所以这里要卖出对应...

## 参考文档

[下载：股票delta是多少.pdf](#)

[《券商引领牛市什么意思呀》](#)

[《股票上市首日破发为什么有人接盘买》](#)

[《新股申购707开头的是什么股》](#)

[《同花顺在哪里看富时中国》](#)

[下载：股票delta是多少.doc](#)

[更多关于《股票delta是多少》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/book/45711816.html>