

举例说明：

现在 50etf 价格 2.066，期权 13 天到期

5	50ETF购3月2000	买	1	0.0781	0.0792	0.0017	-1057.00
	50ETF沽3月2000	买	1	0.0276	0.0282		

使用如下策略，如果 50etf 上涨 10%，则获利 $(2.066 \times 0.1 + 2.066) - 2.106 = 1666$

如果下跌 10%  $(2.206 - 2.066 \times 0.1) - 1.894 = 1054$

投入资金 1057 元每份，如果 50etf 在 1.994 亏损最大，为 1057 元

