

Strategy - Comparison

Questa sezione è dedicata allo studio delle modifiche ad una strategia come anche allo studio di una nuova strategia. E' possibile vedere sia graficamente che numericamente fino a quattro diverse varianti ognuna delle quali caratterizzata da un colore distintivo che viene riportato sia nel payoff che nella tabella delle proprietà. In questo modo risulta di molto facile confrontare diverse mosse e verificare la convenienza o meno delle stesse.

Il menu



Strategies

<p>Strategy 1</p>	<p>seleziona la strategia 1, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore cyan</p>
<p>Strategy 2</p>	<p>seleziona la strategia 2, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore magenta</p>
<p>Strategy 3</p>	<p>seleziona la strategia 3, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore giallo</p>
<p>Strategy 4</p>	<p>seleziona la strategia 4, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore arancio</p>

Actions

<p>Finalize Paper Trading</p>	<p>permette di finalizzare gli ordini e quindi tornare alla sezione General con gli ordini da eseguire in modalità Paper Trading</p>
<p>Finalize Real Market</p>	<p>permette di finalizzare gli ordini e quindi tornare alla sezione General con gli ordini da eseguire in modalità Real Market</p>

 Clear Selected	permette di cancellare tutti gli ordini della strategia selezionata e tornare alla strategia di partenza
 Clear All	permette di cancellare tutti gli ordini di tutte le strategie, in pratica una nuova sessione di comparazione

Payoff

 Reset Zoom & Pan	permette di effettuare il reset dello zoom e tornare quindi alla visualizzazione originale
 Cross Hair	permette di abilitare o disabilitare il Crosshair per il Payoff
 Save as Image	permette di salvare il Payoff della Strategy attualmente in uso in formato immagine (*.png). L'immagine verrà salvata nella cartella Immagini di beeTrader, nei Documenti dell'utente
 Print	permette di stampare il Payoff della Strategy attualmente in uso. Funzione disponibile se sul pc in uso è presente una stampante

Esempio di Comparazione

1. Poniamo per esempio di avere semplicemente 1 put venduta su A2A strike 1.05 con il sottostante che quota 1.092

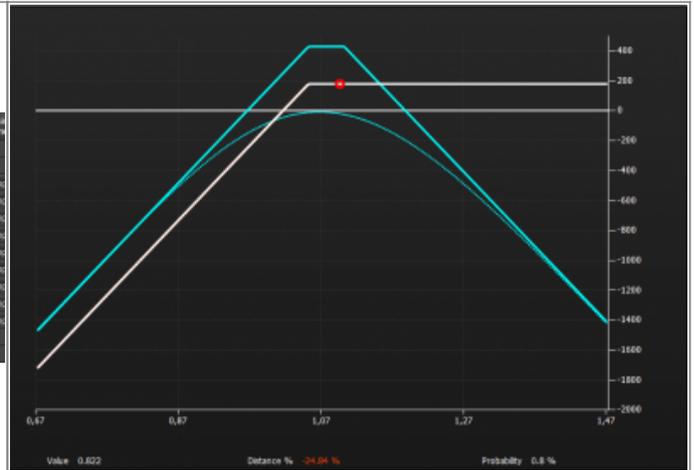


2. Passando sulla scheda Comparison possiamo notare come tutti i valori (la strategia Main cioè quella di partenza e le quattro possibilità di comparazione che offre Iceberg, siano uguali)

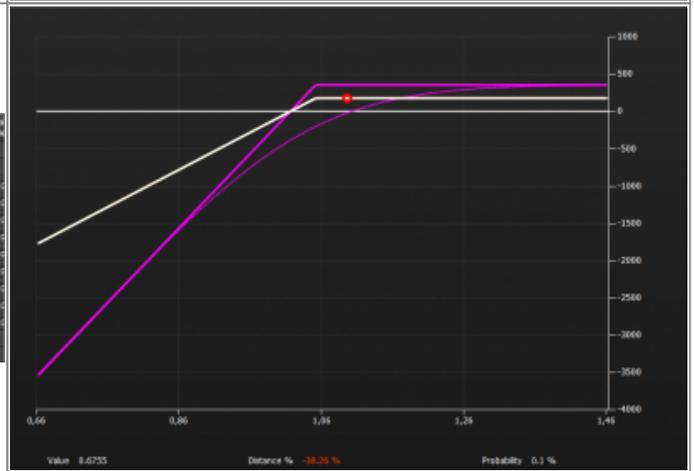
	Net Result	At Now	Realized	Broker Costs	Days to Expires	Max Profit	Max Risk	% Downside Break-Even	% Upside Break-Even	Delta	Gamma	Theta	Vega	Rho	Delta 1%	Vega 1%
Initial	€ 20,00	€ 20,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinito	7,34 %		€ 1756,27	€ -13019,14	€ 2,71	€ 7,89	€ 2,97	€ 18,47	€ 7,62
Strategy 1	€ 20,00	€ 20,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinito	7,32 %		€ 1756,27	€ -13019,14	€ 2,71	€ 7,89	€ 2,97	€ 18,47	€ 7,62
Strategy 2	€ 20,00	€ 20,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinito	7,34 %		€ 1756,27	€ -13019,14	€ 2,71	€ 7,89	€ 2,97	€ 18,47	€ 7,62
Strategy 3	€ 20,00	€ 20,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinito	7,34 %		€ 1756,27	€ -13019,14	€ 2,71	€ 7,89	€ 2,97	€ 18,47	€ 7,62
Strategy 4	€ 20,00	€ 20,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinito	7,34 %		€ 1756,27	€ -13019,14	€ 2,71	€ 7,89	€ 2,97	€ 18,47	€ 7,62

3. Ora cliccando su Strategy 1, Strategy 2, Strategy 3, Strategy 4 si abilita una delle quattro possibilità che ci sono a disposizione per studiare modifiche alla strategia. Per comodità ad ogni strategia è associato un colore e di questo colore saranno colorati il payoff, l'atnow e gli strike sulla Chain. Di seguito vengono ipotizzate quattro possibili modifiche alla strategia.

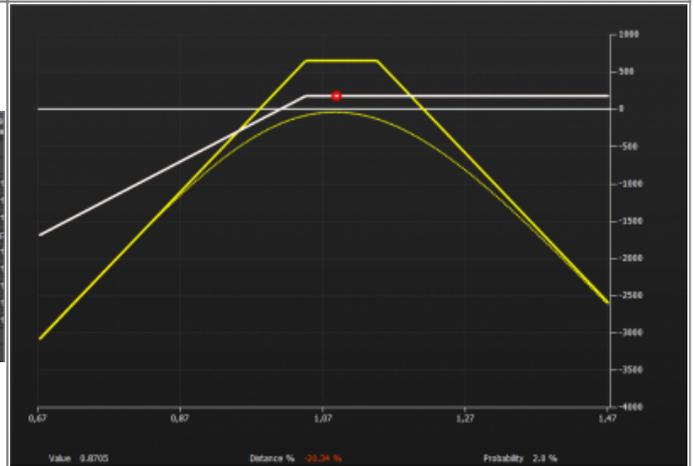
Chain	Real Time	P/L	Avg. Amount	Bid	Ask	Qty	Expiry Strike	Qty	Bid	Ask	Avg. Amount	P/L	Real Time
2018-02-19 (23)													
2018-03-18 (51)													
Stop	€ 0,00	€ 1005,00	0,186	0,216	0	0,0	0	0	0,0075	0,01	€ 43,75	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 705,00	0,143	0,172	0	0,95	0	0	0,0115	0,1135	€ 67,50	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 578,75	0,1065	0,123	0	1	0	0	0,0205	0,023	€ 113,75	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 400,00	0,077	0,083	0	1,05	-1	0	0,0335	0,04	€ 188,75	€ -10,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 260,00	0,05	0,054	-1	1,1	0	0	0,0505	0,042	€ 296,25	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 156,25	0,0295	0,033	0	1,15	0	0	0,086	0,091	€ 442,50	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 87,50	0,0155	0,0195	0	1,2	0	0	0,1115	0,1375	€ 622,50	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 46,25	0,0075	0,011	0	1,25	0	0	0,15	0,18	€ 825,00	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 27,50	0,0035	0,0075	0	1,3	0	0	0,196	0,226	€ 1035,00	€ 0,00	Stop
2018-04-13 (79)													
2018-06-17 (142)													



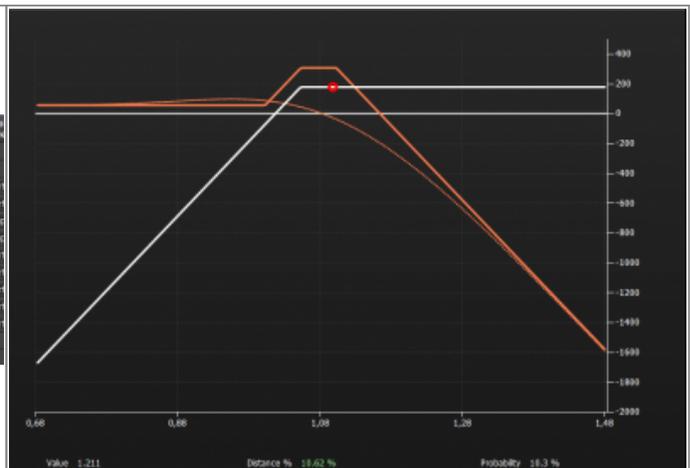
Chain	Real Time	P/L	Avg. Amount	Bid	Ask	Qty	Expiry Strike	Qty	Bid	Ask	Avg. Amount	P/L	Real Time
2018-02-19 (23)													
2018-03-18 (51)													
Stop	€ 0,00	€ 1010,00	0,187	0,217	0	0,0	0	0	0,0075	0,0095	€ 42,50	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 790,00	0,143	0,173	0	0,95	0	0	0,012	0,0155	€ 66,75	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 580,00	0,109	0,123	0	1	0	0	0,021	0,025	€ 115,00	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 403,25	0,077	0,0835	0	1,05	-2	0	0,0305	0,04	€ 188,75	€ -12,50	Stop
Stop	€ 0,00	€ 263,50	0,0585	0,0545	0	1,1	0	0	0,0505	0,0615	€ 296,25	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 157,50	0,0295	0,0325	0	1,15	0	0	0,0805	0,0905	€ 440,00	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 88,75	0,016	0,0195	0	1,2	0	0	0,1115	0,1375	€ 622,50	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 47,50	0,008	0,011	0	1,25	0	0	0,149	0,179	€ 820,00	€ 0,00	Stop
Stop	€ 0,00	€ 27,50	0,0035	0,0075	0	1,3	0	0	0,195	0,225	€ 1030,00	€ 0,00	Stop
2018-04-13 (79)													
2018-06-17 (142)													



Chain	Real Time	P/L	Avg. Amount	Bid	Ask	Qty	Expiry Strike	Qty	Bid	Ask	Avg. Amount	P/L	Real Time
2018-02-19 (23)													
2018-03-18 (51)													
Start	€ 0,00	€ 990,00	0,198	0,198	0	0,0	0	0	0,0035	0,0135	€ 17,50	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 707,50	0,1255	0,1255	0	0,95	0	0	0,009	0,009	€ 45,00	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 507,50	0,1135	0,1135	0	1	0	0	0,019	0,019	€ 95,00	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 400,00	0,08	0,08	0	1,05	-2	0	0,0395	0,04	€ 188,75	€ -12,50	Start
Start	€ 0,00	€ 267,50	0,0535	0,0535	0	1,1	0	0	0,059	0,059	€ 295,00	€ 0,00	Start
Stop	€ 0,00	€ 156,25	0,0295	0,033	-2	1,15	0	0	0,0895	0,0895	€ 442,50	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 102,50	0,0195	0,0295	0	1,2	0	0	0,126	0,126	€ 630,00	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 60,00	0,012	0,012	0	1,25	0	0	0,167	0,167	€ 835,00	€ 0,00	Start
Start	€ 0,00	€ 32,50	0,0065	0,0065	0	1,3	0	0	0,2115	0,2115	€ 1037,50	€ 0,00	Start
2018-04-13 (79)													
2018-06-17 (142)													



Chan	Real Time	P/L	Req. Amount	Bid	Ask	Qty	Qty +	Expiry	Qty -	Bid	Ask	Req. Amount	P/L	Real Time
								2016-02-18 (23)						
								2016-03-18 (51)						
Start	€ 8,00	€ 997,50	0,1995	0,1995	-	0	+	0,5	-	0,0035	0,0035	€ 17,50	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 775,00	0,135	0,135	-	0	+	0,05	-	0,009	0,009	€ 45,00	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 575,00	0,115	0,115	-	0	+	1	-	0,0205	0,0205	€ 112,50	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 497,50	0,0815	0,0815	-	0	+	1,05	-	0,0395	0,0395	€ 185,00	€ 8,00	Start
Stop	€ 17,00	€ 281,25	0,0395	0,0395	-	1	+	1,1	-	0,058	0,058	€ 290,00	€ 8,00	Start
Stop	€ 8,00	€ 180,00	0,0295	0,0295	-	0	+	1,15	-	0,088	0,088	€ 440,00	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 185,00	0,021	0,021	-	0	+	1,2	-	0,1245	0,1245	€ 622,50	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 88,00	0,012	0,012	-	0	+	1,25	-	0,1655	0,1655	€ 827,50	€ 8,00	Start
Start	€ 8,00	€ 32,50	0,0065	0,0065	-	0	+	1,3	-	0,21	0,21	€ 1050,00	€ 8,00	Start
								2018-04-13 (79)						
								2018-06-17 (142)						



4. Ora nella parte in alto di Iceberg vengono visualizzati i valori per tutte e quattro le possibili modifiche che è possibile vedere singolarmente o contemporaneamente sul payoff semplicemente abilitando o disabilitando le Strategy dal menù del testo destro del mouse.

	Net Result	At Now	Realized	Broker Costs	Days to Expires	Max Profit	Max Risk	% Downside Break-Even	% Upside Break-Even	Delta	Gamma	Theta	Vega	Rho	Delta 1%	Vega 1%
Initial	€ 17,50	€ 17,50	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 180,00	€ +Infinity	7,50 %		€ 1730,79	€ 12971,11	€ 2,70	€ 7,49	€ 2,93	€ 10,23	€ 7,59
Strategy 1	€ 35,00	€ 35,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 435,00	€ +Infinity	12,16 %	8,37 %	€ 856,07	€ 27718,63	€ 5,40	€ 16,08	€ 6,55	€ 11,00	€ 15,78
Strategy 2	€ 42,50	€ 42,50	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 352,50	€ +Infinity	7,45 %		€ 3461,58	€ 25946,22	€ 5,41	€ 15,77	€ 5,86	€ 36,46	€ 15,19
Strategy 3	€ 77,50	€ 77,50	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 652,50	€ +Infinity	10,15 %	10,92 %	€ 257,23	€ 55335,88	€ 10,51	€ 31,74	€ 11,15	€ 6,83	€ 36,77
Strategy 4	€ 55,00	€ 55,00	€ 0,00	€ 0,00	51	€ 312,50	€ +Infinity		6,08 %	€ 2018,51	€ 16422,21	€ 2,81	€ 9,91	€ 4,60	€ 23,16	€ 9,47

5. Una volta scelta la versione migliore è sufficiente finalizzare gli ordini (in Paper Trading o in Real Market) per trasferire tutte le operazioni sulla scheda General.

From: http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/ - Iceberg Options Solutions

Permanent link: http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/comparison?rev=1453905039

Last update: 2016/07/12 16:13

