Creazione di una Strategy

Vediamo ora come procedere alla realizzazione di una Strategy analizzando tutti i passi per procedere correttamente.

Video Tutorial

4	24/03/2016	Strategy - Come costruire una strategia in opzioni	6:23
4	24/03/2016	Strategy - Come riportare su Iceberg una strategia già esistente	5:59
4	24/03/2016	Strategy - Come modificare i prezzi di carico di una strategia	2:22
4	20/04/2016	Strategy - Gestione dei Dividendi	5:40
4	22/04/2016	Strategia Passo Passo dall'impostazione della strategia al piano B	18:45

Clicca qui per vedere altri Video di Iceberg

1. Avviare Iceberg

Una volta verificate che le opzioni e i futures siano correttamente codificati, si passa ad avviare Iceberg, una contenuta in beeTrader®. E' possibile avviare Iceberg sia dal menù beeApps che dalla pagina Welcome di beeTrader®. Se non è possibile cliccare il pulsante verificare le abilitazioni proprie abilitazioni nell'area utente del sito PlayOptions.it.

2. Cliccare New Strategy

3. Selezionare Sottostante

A questo punto si apre la Strategy con la vista General nella quale si hanno a disposizione gran parte delle informazioni necessarie.

La prima cosa da fare è scegliere il sottostante sul quale si desidera costruire la strategia, quindi dalla sezione Underlying del menù Strategy si clicca Select Underlying



Successivamente viene proposta la finestra di selezione del sottostante nella quale sono elencati solo i titoli sui quali sono collegate le opzioni, se quindi il sottostante non appare nella lista bisogna collegare la Chain Opzioni ad esso, vedi Symbol Manager per la procedura. Per facilitare la ricerca del sottostante in questa finestra è presente un sistema di filtro per ogni capocolonna. Nell'esempio sono stati raggruppati i sottostanti per mercato semplicemente trascinando l'intestazione della colonna Markets sulla riga sopra.

*		Syn	nbol Selection - Webank - T3 Open		- x		8 8	Symbol Selection - Webank - T3 Open										
Broker Settings						Ш	Broker Settings											
Account			 Deposit 			Ш	Account		 Deposit 		-							
Symbols						Ш	Symbols											
Select Symbol						Ш	Select Symbol											
Search	By N	ame 💌			R Search	Ш	Search By	/ Name 💌 stoxx		R Search								
Available Symbols		Drag a column header her			÷.		Available Symbols	Category			•							
		Symbol	Name	Markets	Category			Symbol	Name	Markets	Expiry							
	- 1	MLEQCON.1061	A2A S.p.A.		Stock	Ш		2 Currencies Future										
	2				Stock	Ш		1										
	3				Stock	ш		5 - EIF										
	4				Stock	ш		4 ETF - Index Hedge										
	5				Stock	ш		5 E Eutura										
	6				Stock	Ш												
					Stock	ш		6 Index										
					Stock	ш												
					Stock	Ш		8 Stock										
	10	NI FOCON 133731	Base Cassel C.s.A	1171	Charle	Ш	1				×							
	Edit	: Symbols List Reloa	d Symbols List		ОК			Edit Symbols List Reload Sym	bols List		ОК							
N	ormal	With	Options 📕 Expired	With Dividends	×	ļ	Norm	al 📃 With Option	ns 📕 Expired	With Dwidends	×							

4. Attendere il download della Chain Opzioni

Una volta scelto il sottostante lo si vedrà apparire nell'area dove poi saranno elencate tutte le legs della strategia.

Dra	Drag a column header here to group by that column														
	Name	Symbol Type	Strike	Expiry	Qty	Bid	Ask	Last	Avg. Price	Implied Vol. %	Delta	At Now	Realized		
V	DJ EURO STOXX 50 Index	Index						3111.46			1.000	\$0.00	\$0.00		

Iceberg una volta selezionato il sottostante procede automaticamente al download della Chain Opzioni, come si può vedere dalle immagini sottostanti.

Chain Real Add Deita Vol. Bid Ask - Qty + Expiry - Qty + Bid Ask Vol. Deta Add Real Time	Chair	n Real Time	Add	Delta	Vol. %	Bid	Ask	-	Qty	Expiry Strike	•	Qty	+	Bid	Ask	Vol. %	Delta	Add	Real Time
										2015-09-25 (2)									
		Start	+	0.86				•	0	3000			+					+	Start
		Start	+					•	0	3025	-		+					+	Start
		Start	+					•	0	- 3050	-		+					+	Start
		Start	+					•	0	3075			+					+	Start
		Start	+			38.5		•	0	3100	-		+					+	Start
		Start	+					-	0	3125	- I		+					+	Start
		Start	+					•	0	3150			+	51.6				+	Start
Please wait while downloading options chain		Start	+					-	0	3175			+	68.2			-0.84	+	Start
		Start	+					•	0	3200	1 ×		+		96			+	Start
										2015-10-02 (9)									
										2015-10-09 (16)									

5. Studio Strategia

Bene, ora che sono a disposizione il sottostante e la Chain Opzioni non resta che studiare la strategia che si desidera attuare. Attraverso il menù che appare con il tasto destro del mouse è possibile scegliere gli strike e le scadenze che interessano. Per approfondire le funzioni della Chain Opzioni, clicca qui.

Poniamo per esempio di voler fare un condor, quindi si vende la put 3050 e la call 3150 e si comprano la put 3000 e la put 3200. Mano a mano che si aggiungono o tolgono contratti di opzioni nella Chain Opzioni, il Payoff si modifica di conseguenza e le operazioni vendono evidenziate in blu sia nella sezione Trades che nella sezione Legs, questo sta ad indicare che le operazioni sono ancora da finalizzare quindi in basket. Nel Payoff vengono rappresentati in colore rosso i Breakeven Points ed in colore verde il prezzo del sottostante a 2 deviazioni standard. Questa è una configurazione di default che l'utente può modificare a suo piacimento, per maggiori informazione sulle funzioni del Payoff, clicca qui. Tutte le proprietà delle opzioni che si leggono nella sezione Legs e Trades sono modificabili a piacimento, per maggiori informazione sulla sezione Legs, clicca qui e per maggiori informazioni sulla sezione Trades, clicca qui.



6. Messa a Mercato

L'operazione di finalizzazione della strategia, quindi di messa a mercato sia in Paper Trading che in Real Market avviene attraverso gli appositi pulsanti presenti nel menù Strategy alla sezione Trading. Si raccomanda di leggere la sezione del manuale relativa all'esecuzione degli ordini in Paper Trading o Real Market, disponibile qui.



Una volta che gli ordini finalizzati la messa a mercato della strategia è completata. La tipologia di trades che è stata eseguita (Paper Trading o Real Market) viene evidenziata nella sezione Trades.

eral	Net Re	sult	At Now	Rea	alzed	Equity N	let Result (% Max	e Profit	Max Risk	c % Dow	n BEP %	Up BE	P Days	to Expiri	es	Elapsed E	ays Delt	a Gam	ma Th	eta 👘	Vega	Rho	Delta 19	6 Bro	ker Costs	Margin ((Theor.)	VaR							
Gen	-E:	0rder	-€ 30,0		E 0,00	€ 0,00 Alerte	-7.43	% €	404,00	-€ 96,0	0	2.20 %	1.50 9	6 169		_		0 -€ 0,	,45 €0, Par	,00 € (0,06 ·	E 2,47	E 21,68	-€ 16,:	52	€ 0,00	e	7.625,92	€ 80,	70			<u> </u>			<u> </u>
2		ondern	luna baa	dan bana		builted ash as															cruca	Greend	THISCOLY		_	_	_	_	_	_	_	_				
char		biag a co	Gliad		e to gioq	by that colum					alled						de de úneo									— AI	t Expiry	- At N	ow / Net	Result						
× 1			Hilled ate/Time			Name		Quantity	Price	1	nied Type	Amount		ealized	Costs	Uni	Price	Volatility	C																	500
Trade	1	2017-12	-28 16.1	1.29	Cal @	3600 2018-0	06-15		62.5	0 Paper	Trading			€ 0,00	€ 0,00	3	539.460																			450
	2	2017-12	28 16.1	1.29	Put @	3450 2018-	06-15		140.3	0 Paper	Trading			€ 0,00	€ 0,00	3	539.460	19.1	-							/				\backslash						350
<u>S</u>	3	2017-12	28 16.1	1.29	Call @	3550 2018-0	06-15		81.6	0 Paper	Trading	€ 816	.00	€ 0,00	€ 0,00	3	539.460	9.0							_/											300
mpar		2017-12	-28 16.1	1.29	Put @	3500 2018-	06-15		161.6	0 Paper	Trading	€ 1.616	.00	€ 0,00	€ 0,00	3	539.460	19.1	-						/										l h	250
8																								1							\backslash					200
1																								/												100
What																																			l	
																				=						_										
alysis																					beeTra	der ®														-50
An																				3.423,	48			3.473,48			3.52	3,48 <mark>353</mark>	7,46		3.573,	48		з	3.623,48	
2																			т	is Point	3443.3	3		Dista	ince -2.	66 %		A	t Expiry	-€ 96.00			At No	w €5.	86	
Hedg		Real		FD	ROT	Time	Rid/Ack	Ack	Rid				Vol					Evr	hiny					Vol				Bid	Ack	Rid/Ask	ROT	RED	Time		Real	
	Chain	Time	Add	%	%	Value	Hits	Hits	Hits	Vega	Theta	Delta	%	Bid				Str	ike	- (2ty +	Bid		%	Delta	Theta	Vega	Hits	Hits	Hits	%	%	Value	Add	Time	
-Uiu	•																	2018-06-	15 (169) 7.46		3:1 5:1															
PIS		Stop	+ 1			€ 449,12	200	200		9,088	-0,2329	0,68		131.7	133.1	-	0 +	34	50	•	1 +	140.2	141.7	19,2	-0,4	-0,5315	9,4477				4,08	-6,46	€ 1.408,97	+	Stop	
A		Stop	+ 1	,58	1,61	€ 559,41				9,3363	-0,2447	0,63	8,7	117.8	119.1		0 +	34	75	-	0 +	151.3	152.9	19,2	-0,42	-0,5339	9,5085				4,38	-6,07	€ 1.520,89		Stop	
olatili		Stop	- 1 - 1	,93	1,95	€ 681,71	16	16		9,4996	-0,2541	0,58	8,9	105.3	105.9		0 +	35	00	-	-1 +	163.2	165.0	19,2	-0,44	-0,5361	9,5551				4,69	-5,7	€ 1.640,56		Stop	
1		Stop	+ 1	66	2,29	E 815 92			0	9,5872	-0,2587	0,54	9	92.4	93.7		-1 +	35	20 50		0 +	189.6	101.4	19,2	-0,46	-0,5383	9,3872	10		10	5,02	-5,35	€ 1.708,35 € 1.770.44		Stop	
		Stop	+ .	3,07	1,99	€ 712,41				9,5678	-0,2618	0,45	9,1	70.6	71,7		0 +	35	75		0 4	204,1	206.0	19,3	-0,5	-0,5432	9,609			0	4,68	-4,74	€ 1.674.44	÷.	Stop	
		Stop	+	3,5	1,71	€ 614,23	206		206	9,4683	-0,2594	0,4	9,1	61.0	61.8		1 +	36			0 +	219.5	221.5	19,5		-0,5464	9,5999						€ 1.579,68	+	Stop	
		Stop	+ 3	3,97	1,46	€ 528,19				9,3154	-0,256	0,36	9,2	52.3	53.3		0 +	36			0 +	235.8	237.9	19,6		-0,5497	9,5789						€ 1.492,40	+	Stop	
	i.,	Stop	+ 4			€ 450,10					-0,2506	0,32		44.6		-	0 +	36	50	•	0 +	253.0	255.2	19,9	-0,56	-0,5539	9,5475				3,88		€ 1.415,14	+	Stop	
-																																				

Si raccomanda di leggere la sezione del manuale relativa all'esecuzione degli ordini in Paper Trading o Real Market, disponibile qui.

Verificare le opzioni da Symbol Manager

In caso non sia disponibile il sottostante desiderato quest'ultimo va codificato in Symbol Manager con le relative opzioni ed eventuali futures.

Poniamo come esempio di voler effettuare una strategia su Eni tramite WeBank.

Aprendo il Symbol Manager ed il titolo Eni si può notare come le caselle di spunta "Aggiungi Futures al Sottostante" e "Aggiungi Opzioni al Sottostante" siano già flaggate, questo significa che il sottostante Eni è configurato. Cliccando poi sui pulsanti "Genera Chain Futures" e "Genera Chain Opzioni" nei tab corrispondenti è possibile verificare che le impostazioni siano corrette, infatti la richiesta delle chain viene effettuata alla piattaforma del broker che deve essere aperta.



Se così non fosse ed il sottostante abbia effettivamente le opzioni quotate sul proprio broker è necessario procedere alla codifica, sul manuale di beeTrader® è presente la procedura da effettuare per ogni broker:Yahoo! Finance, Interactive Brokers - TWS, Iw Bank - Quick Trade & PEI, Webank - T3 Open 8.0.

