Grafico del Futuro

Una volta che un Plan è stato creato può nascere la necessità di verificare il suo funzionamento, ma anche e forse soprattutto verificare se effettivamente le contromosse studiate sono efficaci nelle varie condizioni di mercato.

In Iceberg, proprio per questo scopo, è presente la funzione Simulation, ovvero l'utente ha la possibilità di creare un grafico del titolo sottostante proiettato nel futuro e verificare ogni giorno le diverse condizioni di mercato. Le opzioni sono prezzate con il sistema Market Maker Surfaces proprio di Iceberg.



Il menu

Add Segment	permette di aggiungere un segmento di grafico, sono da impostare le date di inizio e fine segmento ed i prezzi del sottostante ad inizio e fine segmento
Remove Segment	permette di rimuovere un segmento precedentemente aggiunto al grafico
Re-Generate	permette di generare un nuovo grafico con i medesimi parametri dei segmenti che lo compongono

Expiries		permette di scegliere quali scadenze evidenziare sul grafico forward del sottostante									
Reset Zoom & P	an	permette di ripristinare lo zoom originale del grafico forward del sottostante									
Save as Image		permette di salvare il grafico forward del sottostante in formato immagine (*.png)									
Print		permette di stampare il grafico forward del sottostante. Funzione disponibile se sul p uso è presente una stampante									
Reset Zoom & P	an	permette di ripristinare lo zoom originale del payoff									
Cross Hair		permette di abilitare o disabilitare il crosshair per il payoff									
Save as Image		permette di salvare il payoff in formato immagine (*.png)									
Print		permette di stampare il payoff. Funzione disponibile se sul pc in uso è presente una stampante									
Goto Start	pe	nette di rimuovere un segmento precedentemente aggiunto al grafico									
Previous Point	permette di posizionare la simulazione al punto precedente del grafico forward del sottostante										
Next Point	pe so	rmette di posizionare la simulazione al punto successivo del grafico forward del ttostante									

Play	permette di attivare lo scorrimento punto per punto del grafico forward del sottostante	
Stop	permette di spegnere lo scorrimento punto per punto del grafico forward del sottostante	
Help	permette di aprire la pagina del manuale online sul browser internet predefinito	

Chart Builder



te può impostare i diversi segmenti che andranno a comporre il grafico forward del sottostante. Per ogni segmento è possibile impostare data iniziale e finale, prezzo iniziale e finale. Mano a mano che si creano i segmenti, il grafico si compone in modo casuale, ipotizzando l'andamento del sottostate tra le date ed i prezzi impostati dall'utente.

I campi Start Date, End Date, Start Price e End Price sono editabili, gli altri campi sono calcolati e forniscono un'indicazione dello scostamento dei prezzi impostato.

Plan Preview



ificate. Con la rotellina del mouse è possibile zoomare il plan.

Simulation Results

In questa sezione l'utente può verificare per ogni punto del grafico forward del sottostante i parametri della propria strategia e gli eventuali interventi del wotkflow.

Simulation	imulation Results																					
Net Res	it At Now	Realized	Realized Broker Costs		s Days to Expiries		Max Profit	Max	Risk	% Downside Break-Even		ven 1	6 Upside Break-Even	Delta	Gamma	Theta	Vega	Rho	Delta 196	Vega 1%		
€ 822	50 -€ 822,50	€ 0,00		€ 0,00		149	€ 802,5				24.	39 %								€ 57,22		
Drag a column header here to group by that column														F ²⁰⁰⁰								
	Name	Symbol Type	Strike	Expiry			Ask	Last	Avg. Price	Implied Vol. %	Deta	At Nov	Ľ								•	-1000
🖬 Eni Sp		Stock				12,8	12,8	12,8					x <mark>ž</mark>									1000
🖬 Put	10 2016-06-17			2016-06-17		0,65	0,65	0,65		59.338	-0.198			/	-							-2000
E Put 0	9 2016-06-17	PUT		2016-06-17		0,548	0,548	0,548		68.592	-0.151	€ 0,	d i									2000
																						4000
													beeT	rader 🕲								5000
													8,19			10,19				12,19		6000
													This Baint . 8						-		At Name of	

Si può notare la differenza tra le due immagini che rappresentano la strategia iniziale e dopo l'esecuzione della simulazione. Inizialmente la strategia era composta di 5 put vendute a strike 10 con il sottostante a 12,8. Procedendo con la simulazione il sottostante è andato a 9,84 (quindi minore dello strike della put) e, come impostato nel plan, sono state ricomprate le put 10 e vendute le put 9, mantenendo il premio incassato inizialmente. Il payoff è stato mantenuto vendendo 8 contratti.

Simulation Resi	induction Results																					
Net Result	At Now	Realized	Broker Costs		Days to Expiries		Max Profit	Max Risk		% Downside Break-Even		Even	% Upside Break-Eve	n Delta	Gamma	Theta	Vega	Rho	Delta 1%	Vega 1%		
€ 1262,50	€ 0,00	4 1262,50		€ 0,00		107	€ 0,0	0 4 +	Infinito					€ 452,	97 - 6 249,69	€ 5,66			€ 43,45	-6 28,65		
Drag a column header here to group by that column																						-1000
N	same	Symbol Type	Strike	Expiry			Ask	Last	Avg. Price	Implied Vol. 95	Delta	At Nov	1 🖌 🗠	\leq								-500 -0
🖬 Eni SpA		Stock				9,84	9,84	9,84				€ 0,0	10									500
🖬 Put 🔿 10	2016-06-17			2016-06-		0,826	i 0,826	0,826		35.365	-0.489	€ 0,0	10									1000
🖬 Put 🗇 9 2	2016-06-17			2016-06-		0,488	0,488	0,488	0,488	41.863	-0.302	€ 0,0	10									1500
																						2000
																						2500
																						3000
													be	eTrader @								3500
													8,86		9,06	9,26		9,46	9,	66	9,86	4000
											_		This Point	8.885	Dist	ance -0.7	1.%	At	Expiry ፋ 27	728,07	At Now 👍 🛛	728,07

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

Permanent link: http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/grafico_del_futuro?rev=1459516609



Last update: 2016/07/12 16:13