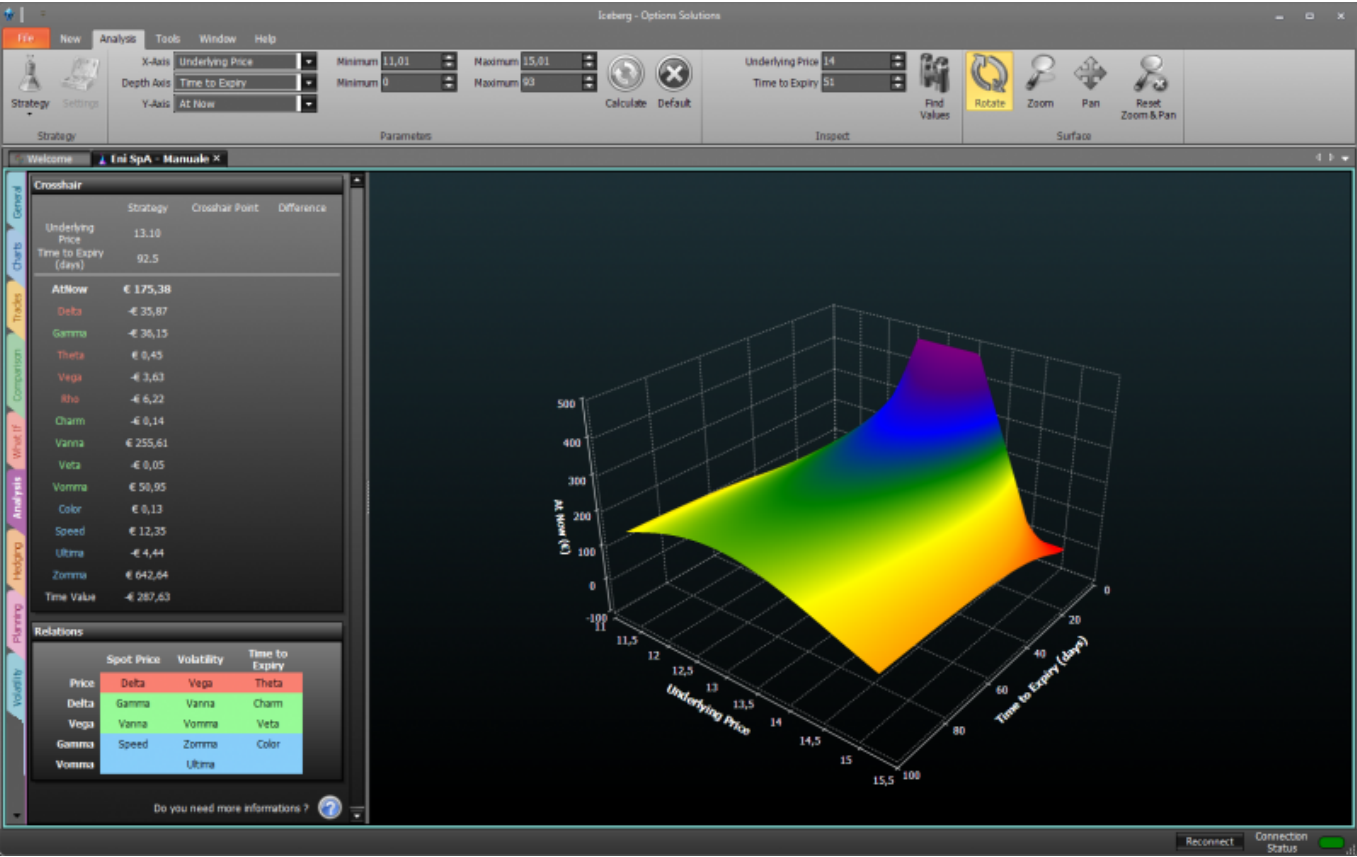
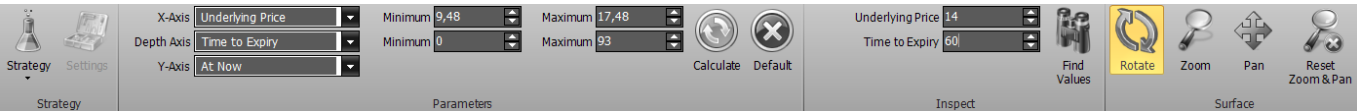


Strategy Analysis

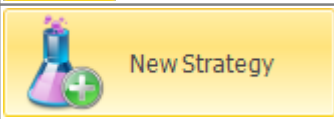
In questa sezione è possibile analizzare il valore le greche della strategia attraverso un grafico 3D completamente personalizzabile. L'utente ha facoltà di scegliere la proprietà da visualizzare in modo da ottenere la rappresentazione grafica che desidera ed in ogni punto può valutare il valore delle greche e atnow della strategia.



Il menu



Strategy

	apre il sottomenu Strategy
	permette di creare una nuova Strategy

 Open Strategy	permette di aprire una Strategy precedentemente salvata
 Save Strategy	permette di salvare la Strategy attualmente in uso

Parameters

X-Axis	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse X, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Depth Axis	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse Depth, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Y-Axis	permette di scegliere la greca da visualizzare sull'asse Y come risultante delle proprietà scelta sull'asse X e Depth, tra Options Price, Delta, Gamma, Theta, Vega, Rho, Vanna, Charm, Speed, Zomma, Color, Veta, Vomma, Ultima, Time Value
Minimum	permette di scegliere il valore minimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta
Maximum	permette di scegliere il valore massimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta
 Calculate	permette di effettuare un nuovo calcolo e quindi un nuovo disegno se sono stati modificati dei parametri
 Default	permette di caricare la configurazione dei parametri di default

Surface

 Rotate	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile ruotare la superficie muovendo il mouse
 Zoom	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile zoommare la superficie muovendo il mouse
 Pan	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile spostare la superficie muovendo il mouse
 Reset Zoom & Pan	permette di azzerare tutte le modifiche grafiche e tornare alla vista iniziale

Crosshair

Crosshair			
Measure	Strategy	Crosshair Point	Difference
Underlying Price	13.41	13.31	-0.10
Time to Expiry (days)	109.5	56.47	-53.06
AtNow	€ 176,88	€ 240,91	€ 64,03
Delta	-€ 60,03	-€ 69,57	-€ 9,54
Gamma	-€ 34,29	-€ 86,95	-€ 52,66
Theta	€ 0,32	€ 0,95	€ 0,62
Vega	-€ 3,72	-€ 5,03	-€ 1,31
Rho	-€ 7,76	-€ 4,85	€ 2,91
Charm	-€ 0,27	-€ 0,54	-€ 0,27
Vanna	€ 468,06	€ 492,68	€ 24,63
Veta	-€ 0,04	-€ 0,10	-€ 0,06
Vomma	€ 57,14	€ 72,34	€ 15,20
Color	€ 0,10	€ 0,47	€ 0,37
Speed	€ 19,54	€ 24,99	€ 5,45
Ultima	-€ 6,15	-€ 5,24	€ 0,92
Zomma	€ 654,97	€ 1.655,63	€ 1.000,66
Time Value	-€ 286,12	-€ 222,09	€ 64,03

Vengono mostrati i valori delle greche e dell'atnow. La prima colonna indica i valori di partenza della strategia, la seconda colonna mostra i valori corrispondenti al punto ove si trova il puntatore del mouse, la terza colonna mostra la differenza tra le precedenti.

Relations

Relations			
	Spot Price	Volatility	Time to Expiry
Price	Delta	Vega	Theta
Delta	Gamma	Vanna	Charm
Vega	Vanna	Vomma	Veta
Gamma	Speed	Zomma	Color
Vomma		Ultima	

Le greche sono legate tra loro secondo le relazioni espresse nella tabella Relations.

Esempio: La greca Speed rappresenta la variazione del Gamma rispetto alla variazione dello Spot Price.

From:

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

Permanent link:

http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/it/analysis?rev=1472473930

Last update: **2016/08/29 14:32**

