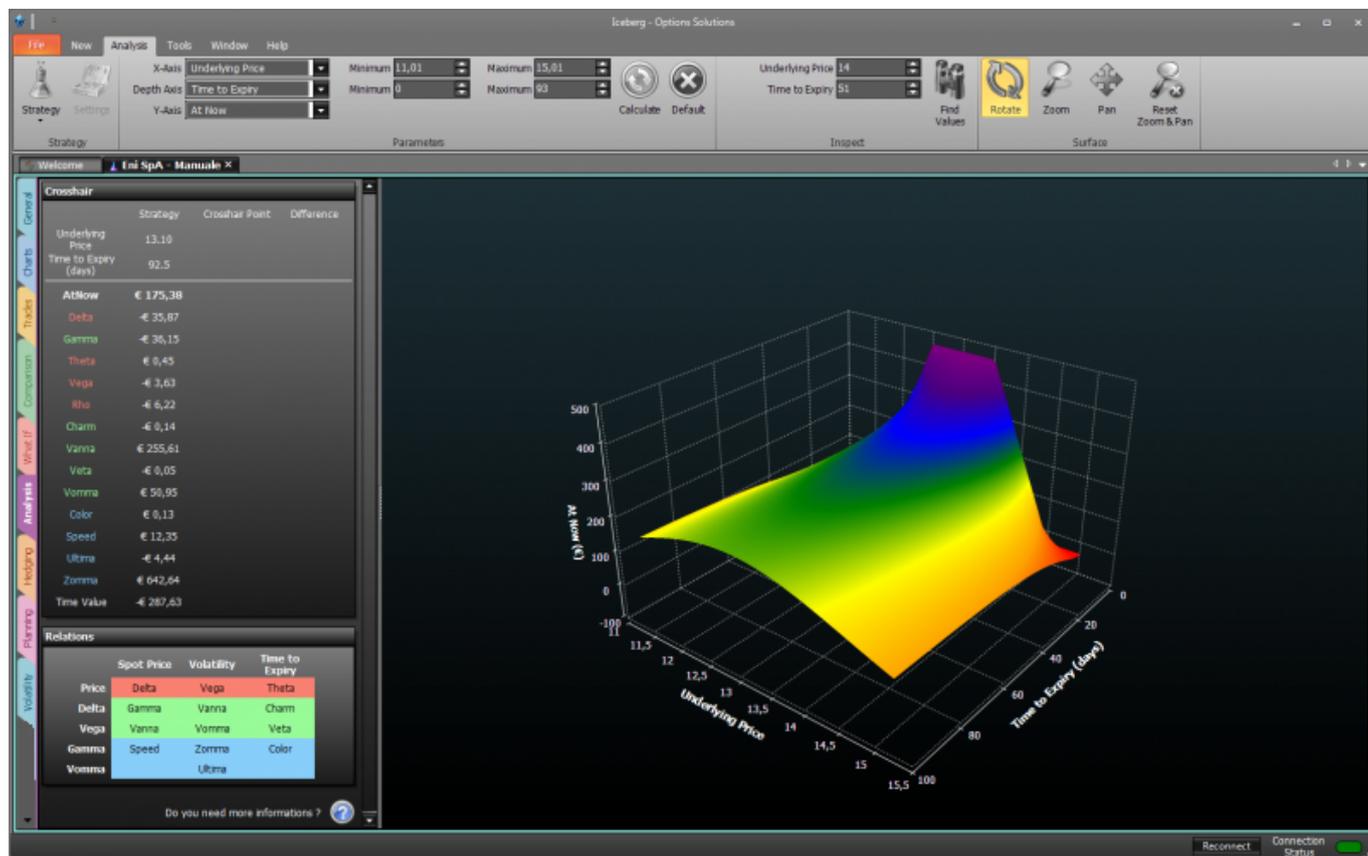


Strategy Analysis

In questa sezione è possibile analizzare la strategia attraverso un grafico 3D completamente personalizzabile che mostra l'evoluzione della stessa in funzione dei parametri impostati dall'utente. 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

 <p>Strategy</p>	apre il sottomenu Strategy
 <p>New Strategy</p>	permette di creare una nuova Strategy

 <p>Open Strategy</p>	<p>permette di aprire una Strategy precedentemente salvata</p>
 <p>Save Strategy</p>	<p>permette di salvare la Strategy attualmente in uso</p>

Parameters

<p>X-Axis</p>	<p>permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse X, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate</p>
<p>Depth Axis</p>	<p>permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse Depth, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate</p>
<p>Y-Axis</p>	<p>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</p>
<p>Minimum</p>	<p>permette di scegliere il valore minimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta</p>
<p>Maximum</p>	<p>permette di scegliere il valore massimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta</p>
 <p>Calculate</p>	<p>permette di effettuare un nuovo calcolo e quindi un nuovo disegno se sono stati modificati dei parametri</p>
 <p>Default</p>	<p>permette di caricare la configurazione dei parametri di default</p>

Surface

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

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=1472475463

Last update: **2016/08/29 14:57**

