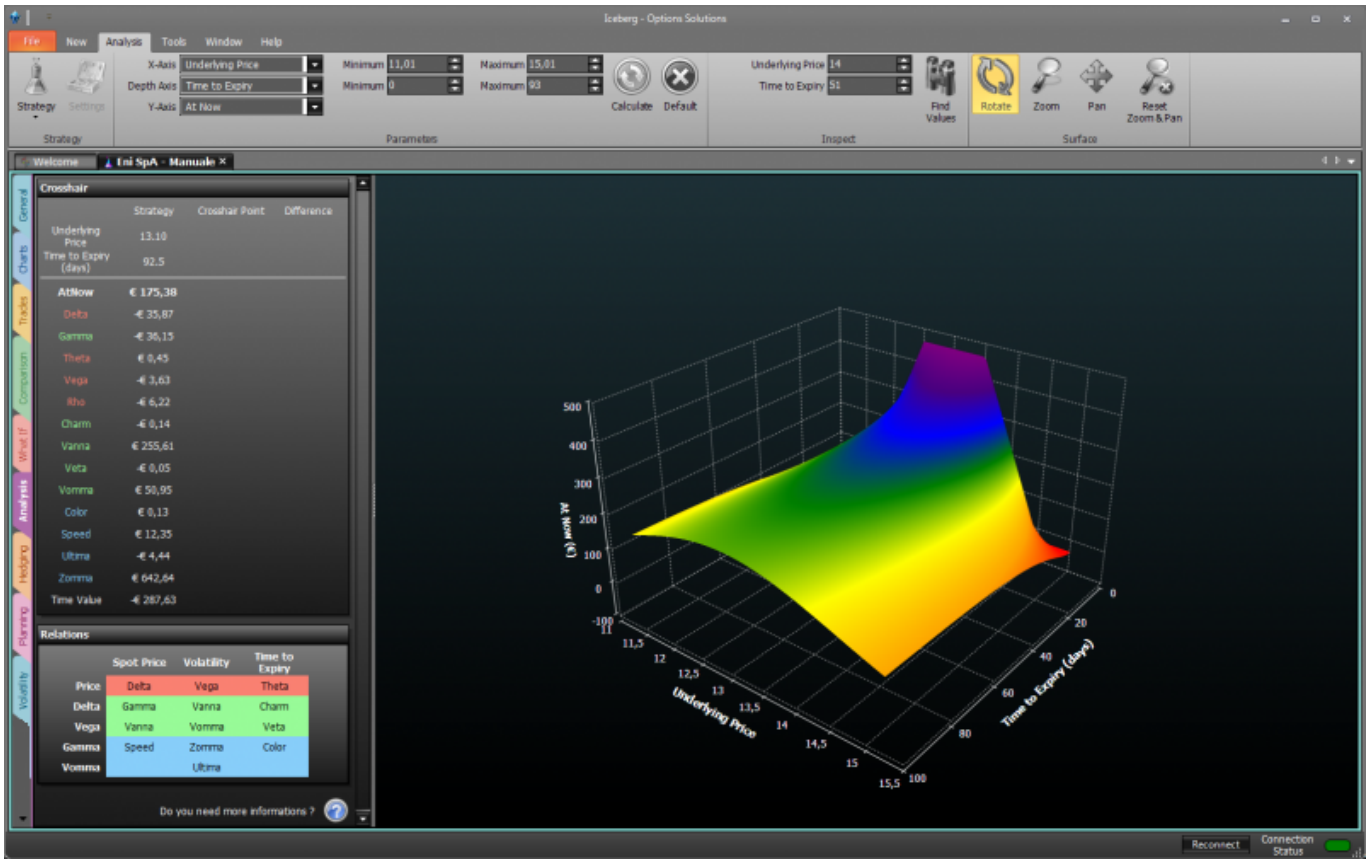
Strategy - Analysis

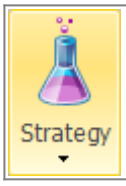
In questa sezione è possibile analizzare la strategia attraverso un grafico 3D completamente personalizzabile che mostra l'evoluzione della stessa in funzione dei parametri impostati dall'utente. L'utente ha facoltà di scegliere la proprietà da visualizzare in modo da ottenere la rappresentazione grafica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

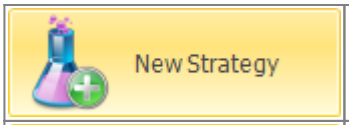
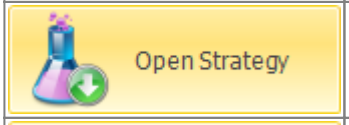
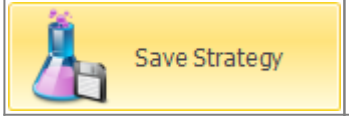
La funzione Analysis va considerata come una versione più sofisticata dell'Options Evaluator in quanto mostra la strategia nel suo complesso con tutte le legs che la compongono, mentre in Options Evaluator è possibile analizzare una singola opzione alla volta.



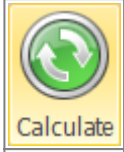
Il menu

Strategy

	apre il sottomenu Strategy

	permette di creare una nuova Strategy
	permette di aprire una Strategy precedentemente salvata
	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
	permette di effettuare un nuovo calcolo e quindi un nuovo disegno se sono stati modificati dei parametri
	permette di caricare la configurazione dei parametri di default

Surface

	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile ruotare la superficie muovendo il mouse
	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile zoommare la superficie muovendo il mouse
	una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile spostare la superficie muovendo il mouse
	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.

Le greche sono suddivise in base alla colorazione per derivata prima (color corallo), seconda (colore verde) e terza (colore azzurro), ovvero greche di primo ordine, di secondo o di terzo ordine.

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.

Le greche sono suddivise in base alla colorazione per derivata prima (color corallo), seconda (colore verde) e terza (colore azzurro), ovvero greche di primo ordine, di secondo o di terzo ordine.

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

Permanent link:
http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/it/analysis?rev=1472739882

Last update: **2016/09/01 16:24**