

Simulazione Montecarlo

Questa funzionalità permette di trarre stime attraverso delle simulazioni utilizzando il [Metodo Montecarlo](#). La finestra è composta principalmente di due sezioni, la sezione Simulation Parameters e la sezione con i relativi grafici.



Video Tutorial

 15/09/2016 [Options Evaluator - Valutatore di Opzioni](#) 16:01 

Clicca [qui](#) per vedere altri [Video di Iceberg](#)

Simulation Parameters

The screenshot shows the 'Simulation Parameters' form with the following fields and values: Initial Price (13.52), Simulation Days (30), Hist. Volatility (20), Upside Break-Even (14.87), Downside Break-Even (12.17), and Simulations (3000). A 'Calculate' button is located at the bottom of the form.

Di seguito l'elenco dei parametri da imputare per avviare una Simulazione Montecarlo:

- Initial Price: prezzo di partenza a partire dal quale verranno effettuati i lanci;

- Simulation Days: durata in giorni della simulazione;
- Standard Deviations: valore di 1 deviazione standard relativa all'andamento del prezzo del sottostante calcolata su 21 giorni;
- Upside Break-Even: limite superiore con il quale verificare la percentuali di probabilità;
- Downside Break-Even: limite inferiore con il quale verificare la percentuali di probabilità;
- Simulations: numero dei lanci che verranno effettuati. Si ricorda che 25000 lanci sono la misura minima per ottenere dei risultati statisticamente attendibili.

Se la Simulazione Montecarlo viene avviata dalla strategia i campi vengono compilato automaticamente con i valori della strategia, dove disponibili.

Results

At Expiry (European style options)	
Above Upside Break-Even	1.1 %
Below Downside Break-Even	0.9 %
Between Up and Down BEPs	98.0 %
Above Up or Below Down BEPs	2.0 %
Highest Value	15.44
Lowest Value	11.78

At Expiry (European style options)

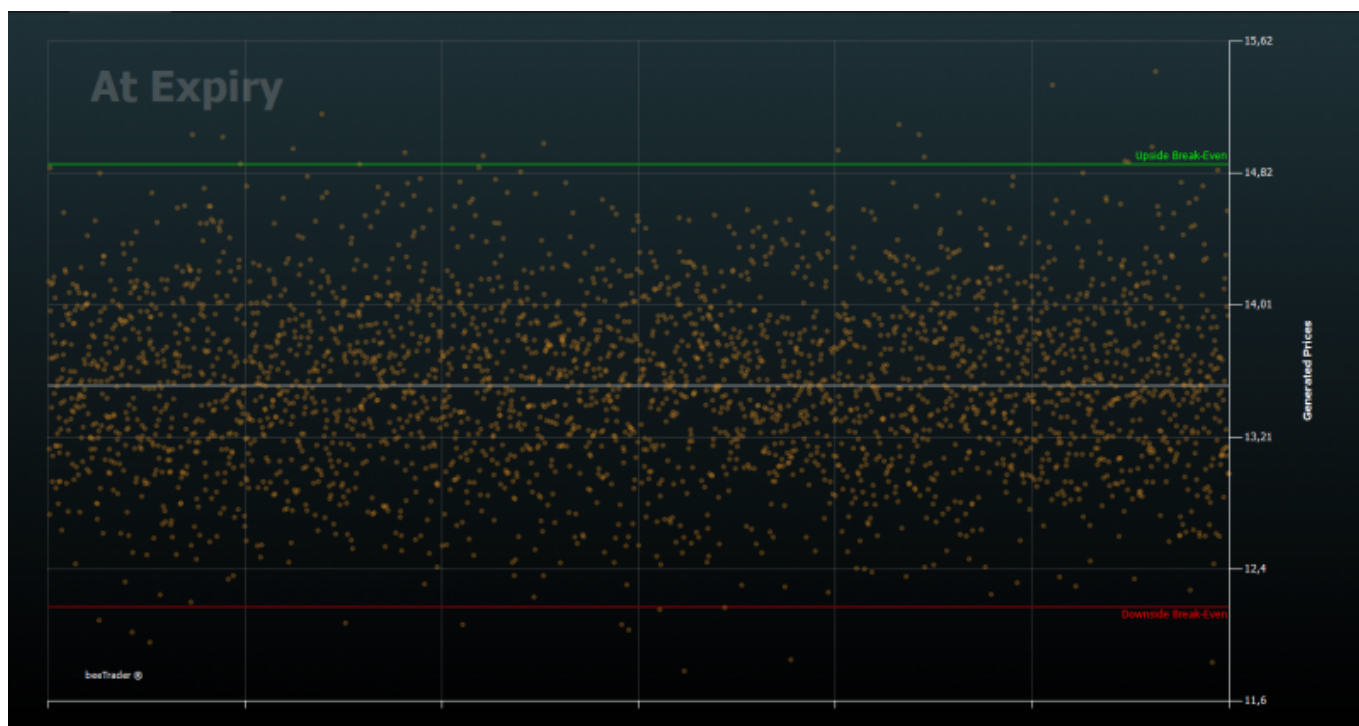
- Above Upside Break-Even: indica la percentuale di probabilità che a scadenza il prezzo del sottostante sia più alto dell'Upside Break-Even Point;
- Below Downside Break-Even: indica la percentuale di probabilità che a scadenza il prezzo del sottostante sia più basso del Downside Break-Even Point;
- Between Up and Down BEPs: indica la percentuale di probabilità che a scadenza il prezzo del sottostante sia compreso tra i Break-Even Points;
- Above Up or Below Down BEPs: indica la percentuale di probabilità che a scadenza il prezzo del sottostante sia fuori dai Break-Even Points.

Any Moment (American style options)	
Above Upside Break-Even	1.0 %
Below Downside Break-Even	1.0 %
Between Up and Down BEPs	98.0 %
Always Between BEPs	98.0 %
Above Up OR Below Down BEPs	2.0 %
Above Up AND Below Down BEPs	0.0 %
Highest Value	15.52
Lowest Value	11.78

Any Moment (American style options)

- Above Upside Break-Even: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia più alto dell'Upside Break-Even Point nel lasso di tempo impostato in Simulation Days;
- Below Downside Break-Even: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia più basso del Downside Break-Even Point nel lasso di tempo impostato in Simulation Days;
- Between Up and Down BEPs: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia compreso tra i Break-Even Points nel lasso di tempo impostato in Simulation Days;
- Always Between BEPs: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia sempre compreso tra i Break-Even Points nel lasso di tempo impostato in Simulation Days;
- Above Up OR Below Down BEPs: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia stato **almeno una volta** superiore all'Upside Break-Even Point **OPPURE** inferiore al Downside Break-Even Point nel lasso di tempo impostato in Simulation Days;
- Above Up AND Below Down BEPs: indica la percentuale di probabilità che il prezzo del sottostante sia stato **almeno una volta** superiore all'Upside Break-Even Point **E** inferiore al Downside Break-Even Point nel lasso di tempo impostato in Simulation Days.

Grafico At Expiry



In questo grafico vengono rappresentati i lanci della Simulazione Montecarlo effettuati, ad ogni lancio corrisponde un pallino. Viene quindi visualizzato il prezzo a scadenza della simulazione, che unito ai Break-Even fornisce un'immediata percezione visiva della simulazione effettuata e di quale sia il prezzo a scadenza.

Questo grafico genera le percentuali mostrate nel box At Expiry.

Grafico Any Moment



In questo grafico, invece, viene indicato il massimo ed il minimo per ogni giorno della simulazione, e non solo alla scadenza della stessa, in questo modo si ha la percezione dello scostamento durante la vita della simulazione.

Questo grafico genera le percentuali mostrate nel box Any Moment.

Data Grid

	Day 1	Day 2	Day 3	Day 4	Day 5	Day 6	Day 7	Day 8	Day 9	Day 10	Day 11	Day 12	Day 13	Day 14	Day 15	Day 16	Day 17	Day 18	Day 19	Day 20	Day 21	Day 22	Day 23	Day 24	Day 25	Day 26	Day 27	Day 28	Day 29
1	13,62	13,76	13,79	13,91	14,05	14,03	13,91	14,01	14,12	14,1	14,11	14,17	14,1	14,02	13,95	14,1	14,16	14,03	13,96	14	13,9	13,87	13,92	13,97	14	13,91	13,96	13,87	14,01
2	13,61	13,74	13,84	13,84	13,9	14,04	14,08	14,06	14,19	14,05	13,95	14,04	13,89	13,74	13,68	13,62	13,57	13,45	13,44	13,37	13,48	13,58	13,58	13,52	13,47	13,33	13,22	13,35	13,27
3	13,55	13,65	13,57	13,43	13,3	13,36	13,21	13,33	13,22	13,1	13,01	13,04	13,19	13,13	13,07	13	12,86	12,86	12,78	12,68	12,52	12,58	12,53	12,62	12,59	12,6	12,61	12,74	12,75
4	13,64	13,59	13,67	13,58	13,59	13,5	13,49	13,41	13,38	13,47	13,56	13,71	13,84	13,76	13,91	13,94	13,93	14,04	14,16	14,29	14,33	14,48	14,63	14,53	14,53	14,45	14,57	14,68	14,76
5	13,57	13,55	13,41	13,52	13,64	13,69	13,83	13,85	13,71	13,57	13,67	13,57	13,62	13,61	13,67	13,78	13,81	13,86	13,92	13,97	14,06	14,08	14,18	14,33	14,17	14,33	14,17	14,02	13,95
6	13,47	13,47	13,44	13,29	13,19	13,05	13,1	13,06	13,04	13,12	13,14	13,19	13,27	13,28	13,31	13,18	13,11	13,14	13,18	13,17	13,26	13,41	13,43	13,55	13,42	13,53	13,55	13,69	13,64
7	13,59	13,38	13,33	13,22	13,28	13,4	13,3	13,31	13,37	13,25	13,18	13,25	13,4	13,29	13,34	13,46	13,44	13,47	13,57	13,69	13,71	13,8	13,89	14,01	13,97	13,84	13,8	13,91	14,04
8	13,37	13,48	13,34	13,28	13,21	13,22	13,1	13,21	13,08	12,96	12,81	12,78	12,82	12,84	12,99	13,12	13,27	13,27	13,31	13,21	13,08	13,18	13,07	12,97	13,1	13,17	13,2	13,27	13,32
9	13,62	13,63	13,73	13,86	13,77	13,75	13,78	13,69	13,76	13,89	13,91	13,88	13,75	13,77	13,85	13,8	13,93	13,78	13,79	13,95	13,82	13,81	13,69	13,72	13,7	13,77	13,91	13,91	13,89
10	13,68	13,53	13,38	13,23	13,21	13,17	13,08	12,97	12,97	13,06	13,05	13,13	13,06	12,92	12,78	12,7	12,69	12,56	12,58	12,57	12,68	12,62	12,74	12,76	12,82	12,96	12,99	13	12,84
11	13,45	13,6	13,64	13,53	13,51	13,37	13,5	13,48	13,55	13,7	13,81	13,68	13,59	13,54	13,46	13,3	13,29	13,37	13,24	13,21	13,28	13,21	13,11	12,98	12,9	12,79	12,89	13,02	13,13
12	13,64	13,73	13,72	13,62	13,65	13,79	13,79	13,87	13,93	14,06	14,19	14,24	14,2	14,08	14,22	14,25	14,27	14,29	14,27	14,35	14,51	14,57	14,46	14,45	14,35	14,21	14,07	14,17	14,24
13	13,4	13,26	13,12	12,97	12,88	13,02	12,94	12,85	12,78	12,81	12,87	12,86	13	13,08	13,19	13,19	13,25	13,25	13,34	13,45	13,6	13,62	13,64	13,59	13,7	13,72	13,8	13,75	13,71
14	13,5	13,57	13,67	13,6	13,51	13,58	13,69	13,67	13,69	13,52	13,55	13,56	13,45	13,47	13,55	13,41	13,49	13,58	13,72	13,88	13,93	13,97	13,97	14,02	13,9	13,95	14,08	14,12	14,2
15	13,61	13,59	13,58	13,73	13,77	13,63	13,6	13,59	13,53	13,39	13,3	13,33	13,39	13,46	13,53	13,37	13,24	13,32	13,17	13,31	13,37	13,46	13,5	13,59	13,64	13,78	13,67	13,68	13,61
16	13,56	13,71	13,6	13,39	13,62	13,55	13,45	13,3	13,43	13,57	13,43	13,37	13,34	13,33	13,48	13,35	13,49	13,64	13,72	13,85	13,86	13,8	13,69	13,77	13,66	13,63	13,53	13,65	13,64
17	13,6	13,72	13,77	13,7	13,74	13,88	13,79	13,94	13,86	13,75	13,71	13,86	13,88	13,92	13,93	13,94	14,05	13,98	14,08	14,09	14,12	14,14	14,24	14,22	14,29	14,22	14,12	14,13	14,05
18	13,45	13,43	13,6	13,5	13,42	13,56	13,58	13,57	13,64	13,59	13,6	13,63	13,58	13,7	13,61	13,56	13,47	13,59	13,75	13,68	13,57	13,61	13,54	13,39	13,25	13,18	13,24	13,12	13
19	13,68	13,66	13,55	13,5	13,47	13,47	13,56	13,43	13,32	13,33	13,39	13,26	13,21	13,06	13	13,07	13,18	13,28	13,27	13,29	13,26	13,19	13,11	13,17	13,14	13,04	12,94	12,9	12,98
20	13,66	13,69	13,84	13,91	13,95	13,95	14,11	14,09	14,09	14,03	13,87	13,97	13,83	13,79	13,7	13,62	13,72	13,7	13,63	13,67	13,54	13,59	13,5	13,36	13,36	13,42	13,42	13,36	13,19
21	13,44	13,59	13,62	13,78	13,73	13,64	13,6	13,63	13,57	13,63	13,75	13,82	13,69	13,69	13,82	13,94	14,1	14,2	14,2	14,07	14,13	14,13	14,23	14,24	14,15	14,22	14,08	13,96	13,86
22	13,37	13,5	13,54	13,62	13,7	13,79	13,77	13,8	13,84	13,96	14,11	14,17	14,07	14,23	14,29	14,15	14,12	14,2	14,1	13,94	13,94	13,89	13,92	13,85	13,93	13,81	13,66	13,49	13,56
23	13,53	13,53	13,48	13,63	13,78	13,63	13,64	13,5	13,39	13,48	13,37	13,24	13,26	13,42	13,32	13,3	13,21	13,36	13,39	13,24	13,36	13,22	13,32	13,25	13,4	13,33	13,45	13,37	13,33
24	13,39	13,32	13,17	13,12	13,04	13,08	13,18	13,33	13,27	13,36	13,36	13,38	13,49	13,55	13,42	13,42	13,33	13,32	13,17	13,2	13,31	13,21	13,32	13,44	13,59	13,56	13,7	13,81	13,68
25	13,54	13,62	13,58	13,42	13,3	13,22	13,22	13,24	13,21	13,22	13,26	13,25	13,37	13,39	13,34	13,22	13,17	13,12	13,12	12,97	12,81	12,84	12,98	12,98	12,88	13,03	12,99	12,97	12,94
26	13,47	13,39	13,37	13,49	13,36	13,2	13,28	13,28	13,39	13,41	13,46	13,4	13,32	13,26	13,29	13,33	13,31	13,24	13,19	13,31	13,22	13,11	13,12	13,11	12,95	12,81	12,94	12,8	12,86
27	13,49	13,36	13,33	13,42	13,49	13,58	13,72	13,62	13,64	13,68	13,74	13,78	13,76	13,61	13,59	13,44	13,39	13,3	13,27	13,25	13,19	13,29	13,39	13,37	13,23	13,28	13,22	13,15	13,21
28	13,4	13,3	13,28	13,22	13,18	13,09	12,97	12,99	13,1	13,06	12,92	12,93	12,84	12,83	12,96	12,94	13,07	13,12	13,13	13,2	13,2	13,15	13,12	13,08	13,18	13,13	13,04	13,03	12,96
29	13,52	13,56	13,59	13,67	13,77	13,87	13,82	13,73	13,57	13,41	13,41	13,57	13,66	13,7	13,79	13,65	13,65	13,58	13,44	13,32	13,26	13,42	13,27	13,16	13,28	13,28	13,2	13,25	13,22
30	13,36	13,27	13,24	13,39	13,25	13,3	13,43	13,54	13,64	13,76	13,61	13,75	13,63	13,69	13,63	13,47	13,53	13,38	13,28	13,12	13,03	13,1	12,95	12,94	12,92	12,93	12,85	12,92	12,94
31	13,44	13,56	13,42	13,3	13,4	13,54	13,62	13,5	13,6	13,71	13,75	13,69	13,63	13,54	13,49	13,57	13,57	13,46	13,57	13,64	13,52	13,42	13,54	13,43	13,37	13,25	13,19	13,23	13,18
32	13,38	13,41	13,38	13,32	13,13	13,04	13,03	13,16	13,22	13,47	13,34	13,24	13,12	13,17	13,21	13,24	13,48	13,63	13,54	13,46	13,35	13,28	13,47	13,54	13,38	13,31	13,45	13,33	13,48

La tabella mostra i prezzi generati dai lanci impostati per ogni giorno della simulazione.

From:

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

Permanent link:

http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/it/simulazione_montecarlo?rev=1473945653



Last update: 2016/09/15 15:20