What-If - UNDER CONSTRUCTION

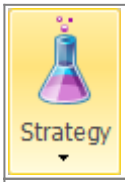
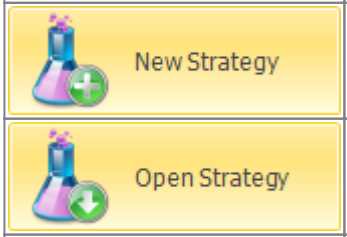
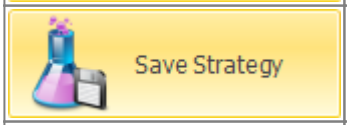
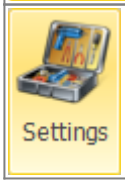
In questa sezione l'utente ha la possibilità di verificare cosa accadrà alla sua strategia nelle condizioni di mercato che l'utente stesso ipotizza. Partendo dalla strategia di base, è possibile modificare la data, il prezzo del sottostante e la volatilità e testare fino a quattro eventuali mosse future.
Di seguito un esempio pratico di utilizzo.

Video Tutorial

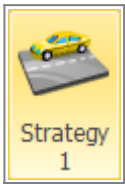
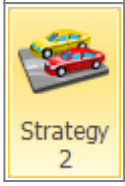
Clicca qui per vedere altri Video di Iceberg

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
	apre la finestra Strategy Settings per le impostazioni della strategia

What-If

	seleziona la strategia 1, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore cyan
	seleziona la strategia 2, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore magenta

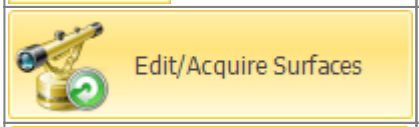
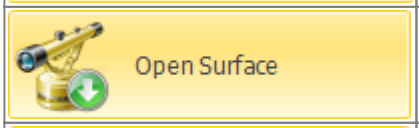
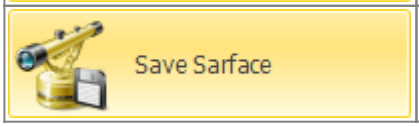
Strategy 3	seleziona la strategia 3, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore giallo
Strategy 4	seleziona la strategia 4, da questo momento tutte le operazioni verranno effettuate su questa strategia e di riflesso sul payoff di colore arancio

Actions

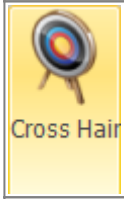
Apply	conferma le operazioni effettuate con le impostazioni correnti. Quando viene cliccato il pulsante Apply il sistema salva le operazioni effettuate nella finestra What-If History. Per maggiori informazioni sulla finestra What-If History, clicca qui
Clear Selected	permette di cancellare tutti gli ordini della strategia selezionata e tornare alla strategia di partenza
Clear All	permette di cancellare tutti gli ordini di tutte le strategie, in pratica una nuova sessione di What-If
What-If History	apre la finestra What-If History dove sono memorizzate tutte le operazioni effettuate e memorizzate dalla funzione What-If

Options Chain

Filter Expiries	permette di filtrare le scadenze visibile sulla Chain Opzioni. Per maggiori sulla Chain Opzioni, clicca qui
Filter Strikes	permette di filtrare gli strike visibile sulla Chain Opzioni. Per maggiori sulla Chain Opzioni, clicca qui
Default Filters	permette di annullare le modifiche ai filtri di scadenze e/o strikes e tornare alla visualizzazione di default

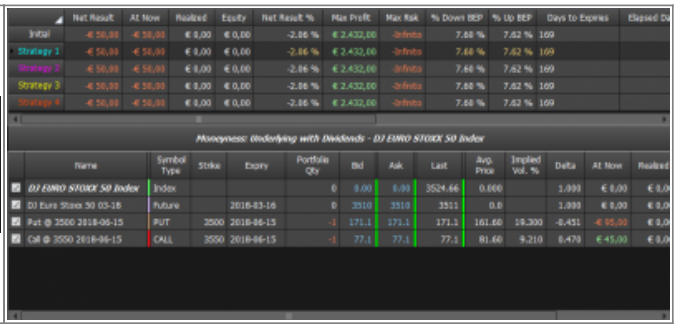
	apre il sottomenù Market Maker Surfaces il tool che permette l'elaborazione delle superfici di volatilità sulle quelli sono calcolati i prezzi teorici
	permette di avviare la finestra Market Maker Surfaces per il sottostante selezionato acquisendo l'attuale superficie di volatilità dal mercato
	permette di avviare la finestra Market Maker Surfaces per il sottostante selezionato ed utilizzare una superficie precedentemente salvata
	permette di salvare la superficie attuale per poterla utilizzare in futuro

Payoff

	permette di effettuare il reset dello zoom e tornare quindi alla visualizzazione originale
	permette di abilitare o disabilitare il Crosshair per il Payoff
	permette di salvare il Payoff della Strategy attualmente in uso in formato immagine (*.png). L'immagine verrà salvata nella cartella Immagini di beeTrader, nei Documenti dell'utente
	permette di stampare il Payoff della Strategy attualmente in uso. Funzione disponibile se sul pc in uso è presente una stampante

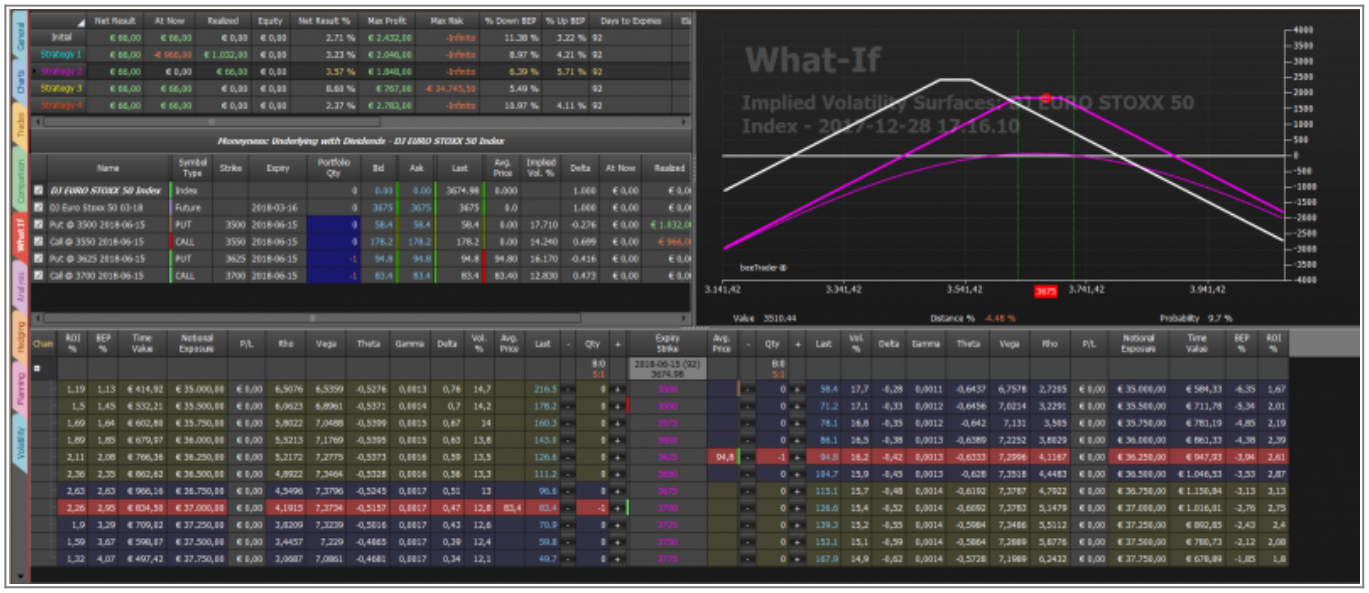
Esempio di What-If

1. Poniamo per esempio di avere uno strangle sul FTSE MIB 40 Index con il sottostante che quota 17000, quindi - 1 put 15000 e - 1 call 19000 su scadenza 06/2016

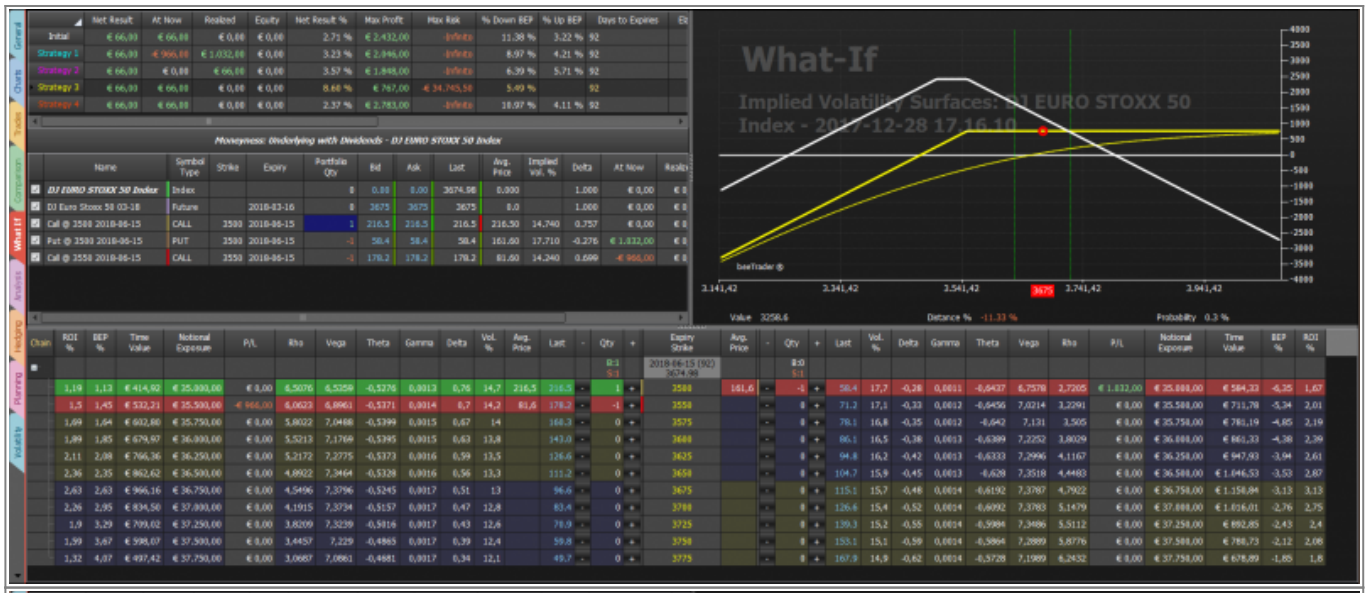


2. Passando sulla scheda What-If possiamo notare come tutti i valori (la strategia Main cioè quella di partenza e le quattro possibilità di what-if che offre Iceberg, siano uguali), a fianco della sezione con le proprietà delle strategie è presente il pannello che permette di impostare i parametri futuri del sottostante per vedere cosa accadrebbe alla strategia in quelle condizioni

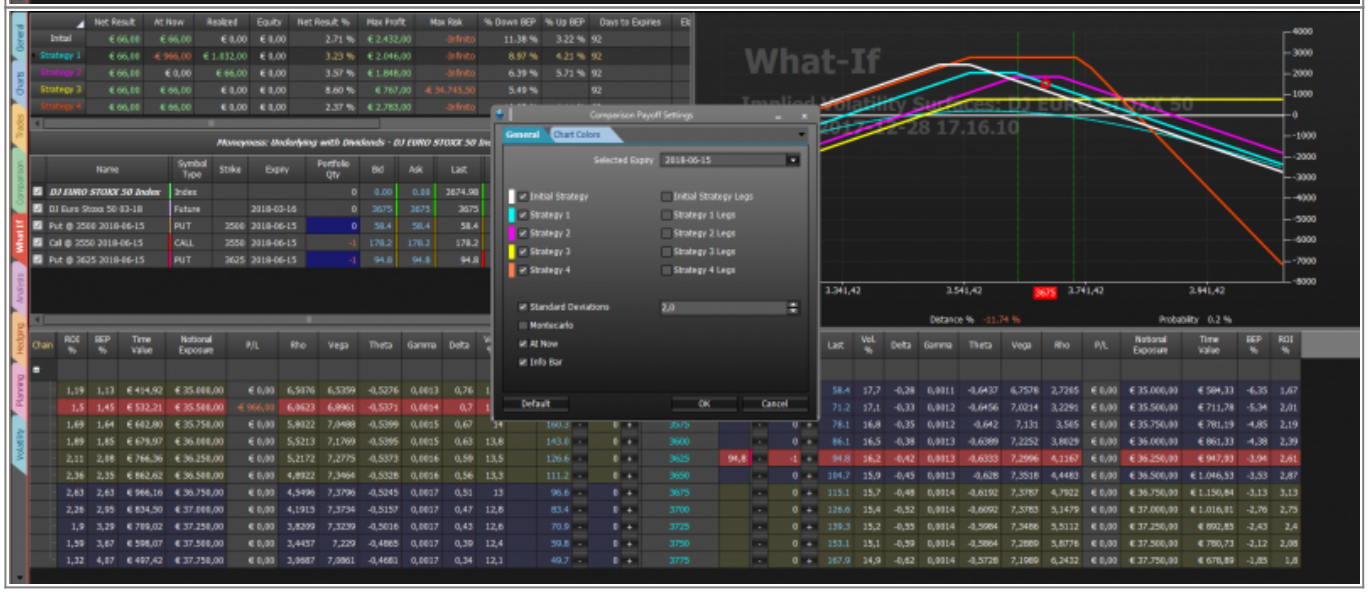
3. Cosa accadrebbe alla mia strategia se il sottostante dovesse arrivare a 19000 diciamo il 20/05/2016? Con Iceberg è possibile rispondere a questa domanda semplicemente impostando i parametri desiderati nella sezione Settings.

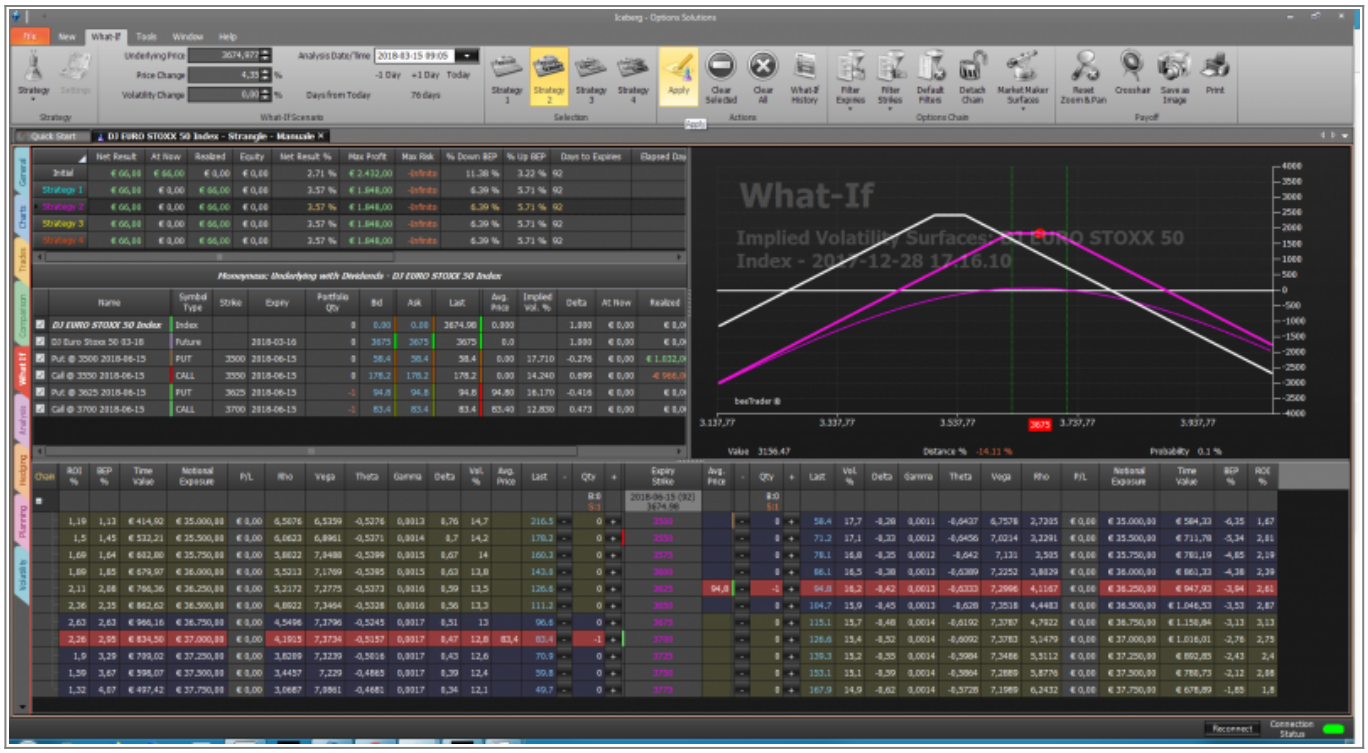


4. Si nota che la put 15000 guadagna 762,50 € mentre la call 19000 ne perde 770,00€. A questo è possibile utilizzare le quattro strategie disponibile per studiare le mosse da fare

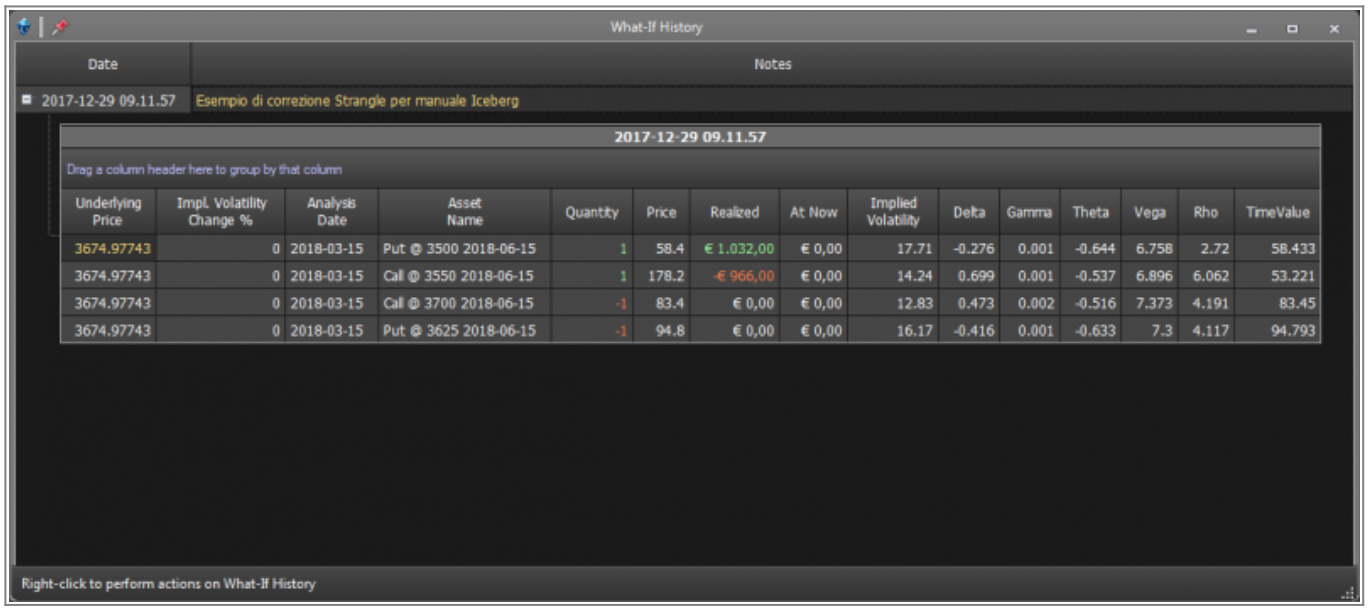

What-If
Implied Volatility Surfaces: DJ EURO STOXX 50 Index - 2017-12-28 17.16.10
Moneyness: Underlying with Dividends - DJ EURO STOXX 50 Index

What-If
Implied Volatility Surfaces: DJ EURO STOXX 50 Index - 2017-12-28 17.16.10
Moneyness: Underlying with Dividends - DJ EURO STOXX 50 Index


What-If
Comparison Payoff Settings
General
Chart Colors
Selected Expiry
Initial Strategy
Strategy 1
Strategy 2
Strategy 3
Strategy 4
Initial Strategy Legs
Strategy 1 Legs
Strategy 2 Legs
Strategy 3 Legs
Strategy 4 Legs
Standard Deviations
Montecarlo
At Now
Info Bar
Default
OK
Cancel

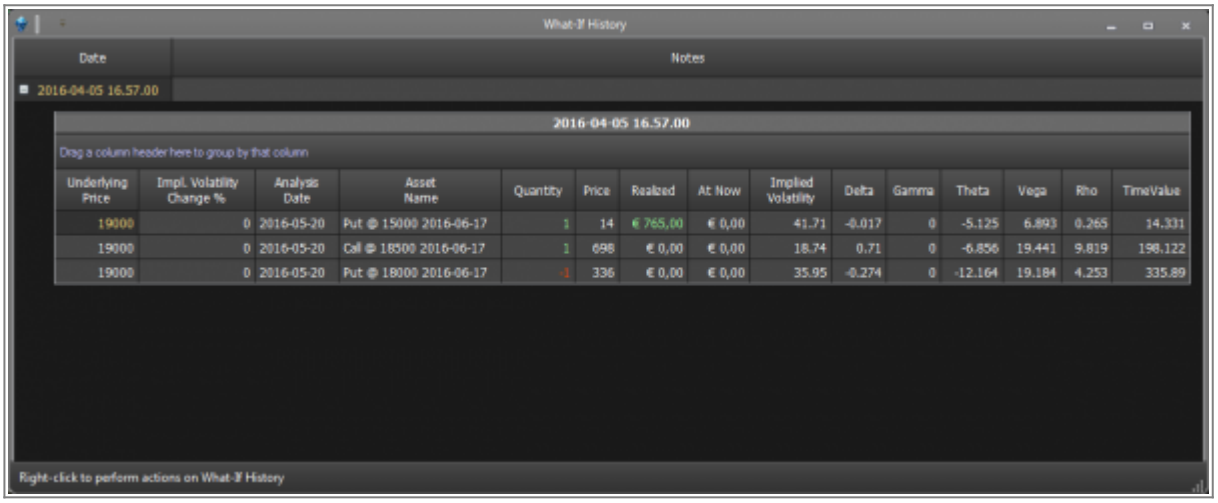


5. Ora nella parte in alto della sezione What-If vengono visualizzati i valori per tutte e quattro le possibili modifiche che è possibile vedere singolarmente o contemporaneamente sul payoff semplicemente abilitando o disabilitando le Strategy dal menù del testo destro del mouse.



6. Una volta decisa la modifica alla strategia che più aggrada (ipotizziamo la Strategia 3, quella gialla) si clicca sul tasto Apply, così facendo la modifica effettuata viene salvata come strategia di partenza ed è possibile procedere con la simulazione avendo nuovamente a disposizione ben quattro possibili varianti.

Tutte le modifiche effettuate alla strategia di partenza vengono salvate in What-If History, dove verrà creata una nuova sezione per ogni nuova sezione di What-If effettuata sulla strategia.



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

Permanent link:
http://manuals.playoptions.it/Iceberg/what-if?rev=1459868712

Last update: **2016/07/12 16:13**