

Изменение страйка опционной позиции

Изменить страйк можно:

- у каждой отдельной опционной позиции;
- у всех опционных позиций в стратегии;
- у всех опционных позиций в нескольких стратегиях.

При смене страйке программа меняет страйк и у позиции, и у сделок, относящихся к позиции.

Содержание страницы:

- Изменения страйка позиции
- Изменение страйка у всех позиций в стратегии
- Изменение страйка позиций в нескольких стратегиях

Изменения страйка позиции

Изменение страйка у позиции невозможно, если:

- опционная позиция содержит реальные сделки;
- в стратегии уже есть позиции (по опциону call/put) на страйке, который мы хотим установить/на который хотим сместиться);
- страйка нет в опционной серии.

Изменить страйк у позиции можно несколькими способами:

1. Нажать на ячейку и выбрать значение из списка доступных страйков.

	Q	Instrument	Strike	Exp	Positio...	
Strategy1						
✗	✓	-1	CME ES FC U16 2230	2230,0	21	M
✗	✓	2	CME ES FC U16 2165		21	M
✗	✓	3	CME ES FP U16 2175	100,0	21	R
✗		0	500,0			
✗		0	800,0			
			825,0			
			850,0			
			875,0			

Рисунок 1 – изменение страйка опциона

Некоторые страйки могут отсутствовать. Это значит, что данный страйк невозможно установить (см. Требования к позициям для смены страйка)

2. Нажать на строку позиции правой кнопкой мыши и выбрать команду Shift. В результате откроется список доступных подкоманд:

- a. Shift N strike up (+N) – сдвинуть цену вверх на N страйков.
- b. Shift N strike down (-N) – сдвинуть цену вниз на N страйков.

Максимально возможное количество страйков, на которое можно сдвинуть цену вверх/вниз – 5, минимальное – 1.

CME ES FC U16 2230	2230,0	21	M	7,6569	14	-14	1,46129	1,4
CME ES FC U16 2165	2165,0			11,0016	27,25	54,5	26,97011	26,75
CME ES FP U16 2175	2175.0			10,3607	22,5	67,5	23,0077	22,25
				0,0000	27	108	0	118,65
						108	0	118,65

Рисунок 2 – изменение страйка опциона через контекстное меню

Например, в стратегии по инструменту CME ES FC U16 2180 открыта позиция на страйке 2180. Шаг страйка – 5. Если выбрать команду Shift 3 strike up, то значение сдвинется на три страйка вверх. Страйк у позиции установится на отметке 2195. Значение страйка можно проверить в доске опционов.

Bid	Vola	Last	Position	Strike	Position	Last	Ask	Theo
36,75	11,4	35,00		2155,00		14,25	14,50	14,26
33,00	11,1	32,75		2160,00		16,25	15,75	15,49
29,50	10,9	28,25	2	2165,00		16,75	17,00	16,88
26,00	10,5	26,00		2170,00		18,25	18,50	18,38
22,50	10,2	23,75		2175,00	3	20,00	20,25	20,01
19,50	9,82	20,00	1	2180,00		21,50	22,25	21,87
16,50	9,49	16,75	1	2185,00		25,25	24,25	23,88
13,75	9,23	14,00	2	2190,00		25,75	26,50	26,13
11,25	8,87	11,50	3	2195,00		33,00	29,00	28,63
9,00	8,55	9,50		2200,00		34,50	31,75	31,38

Рисунок 3 – доска опционов

Q	Instrument	Strike	Exp	Positio...
Strategy1				
1	CME ES FC U16 2195	2195,0	21	M
2	CME ES FC U16 2165	2165,0	21	M
3	CME ES FP U16 2175	2175.0	21	R
0				
0				

Рисунок 4 – результат смещения страйка

Некоторые команды могут отсутствовать, если сместиться на интересующий страйк невозможно (см. Требования к позициям для смены страйка).

Q	Instrument	Type	Strike	Exp	Position...	Vola	Price	Volume	Last	Theo	P&L
-2	CME ES FC U16 21...	call	2170,0	17	M	10,0372	23,25	-46,5	23,25	23,69903	-0,89806
-1	CME ES FC U16 21...	call	2155,0	17	M	10,9711	34,5	-34,5	34,5	34,70691	-0,20691
1	CME ES FC U16 21...	call	2175,0	17	M	9,5734	21,25	21,25	21,25	20,0836	-1,1664
1	CME ES FC U16 21...	call	2195,0	17	M	8,2855	20	20	8,75	8,96636	-11,03364
1	CME ES FC U16 22...	call	2200,0	17	M	7,8766	16,25	16,25	16,25	16,20677	-18,87968
2	CME ES FC U16 21...	call	2165,0	17	M	54,5	27	27	27,332	27,332	0,16399
3	CME ES FP U16 2...	put	2175,0	17	M	67,5	16,25	16,25	16,25	16,20677	-18,87968
0		options						89		0	-32,04792
0		total						89		0	-32,04792

Рисунок 5 – пример меню с несколькими командами

Изменение страйка у всех позиций в стратегии

Команда не доступна, если:

- в стратегии есть опционные позиции, содержащие реальные сделки;
- страйка нет в опционной серии.

Чтобы сместить страйк у всех позиций в стратегии, нужно нажать на стратегию правой кнопкой мыши и выбрать команду Shift Shift N strike up/down, где N – количество страйков, например, Shift 2 strike up – переместиться на два страйка вверх, Shift 5 strike down – переместиться на 5 страйков вниз.

Q	Instrument	Strike	Exp	Position...	Vola
	CME ES FC U16 2170	2170,0	17	M	10,0372
	CME ES FC U16 2155	2155,0	17	M	10,9711
	CME ES FC U16 1025	1025,0	17	M	0,0031
	CME ES FC U16 2190	2190,0	17	M	8,5297
	CME ES FC U16 2200	2200,0	17	M	7,8766
	CME ES FC U16 2185	2185,0	17	M	8,8959
					0,0000
					0,0000

Рисунок 6 – смещение страйков всех позиций стратегии

Некоторые подкоманды могут отсутствовать, если сместиться на интересующий страйк невозможно (см. Требования для смены страйка по всем инструментам стратегии).

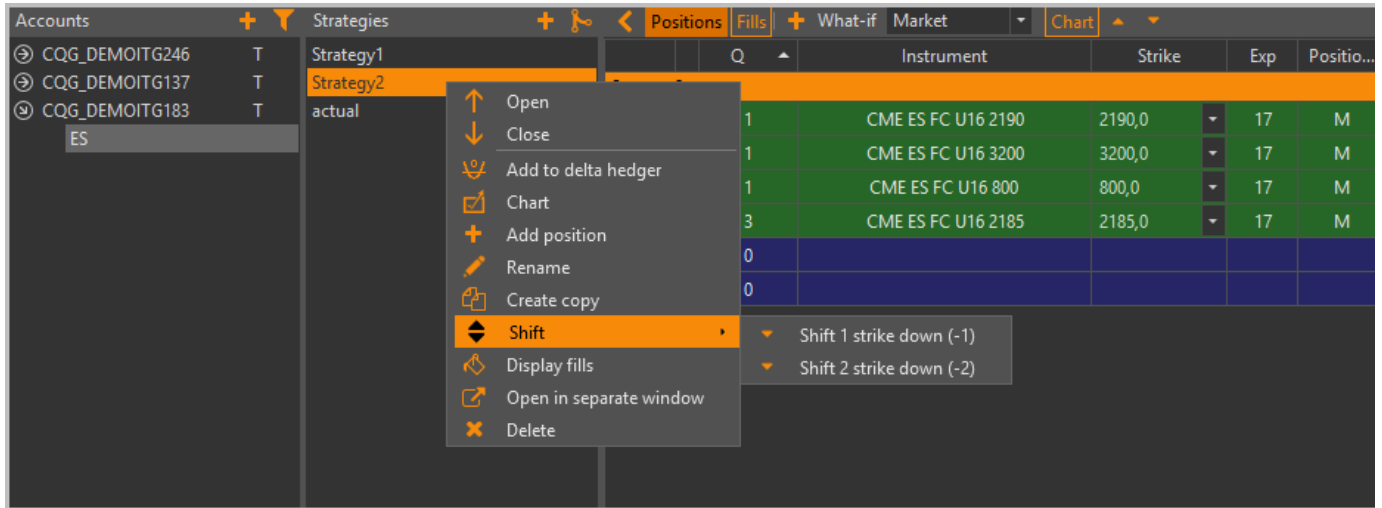


Рисунок 7 – пример контекстного меню

Изменение страйка позиций в нескольких стратегиях

Смещение невозможно, если:

- в стратегии есть опционные позиции, содержащие реальные сделки;
- страйка нет в опционной серии.

С помощью кнопок Shift up (+1)/Shift down (-1) на верхней панели можно сместить страйки позиций в нескольких выбранных стратегиях одновременно.

	Q	Instrument	Strike	Exp	Positio...	Vola	Price	Volume	Theo	Bid
✗	-2	CME ES FC U16 2180	2180,0	17	M	9,2621	23,25	-46,5	16,95925	16,75
✗	-1	CME ES FC U16 2165	2165,0	17	M	10,4156	34,5	-34,5	27,332	26,75
✗	1	CME ES FC U16 1075	1075,0	17	M	0,0031	33	33	1103,75	0
✗	1	CME ES FC U16 2200	2200,0	17	M	7,8766	11,25	11,25	6,72277	6,5
✗	0					0,0000	36,75	-36,75	0	-56
✗	0					0,0000	36,75	-36,75	0	-56

Рисунок 8 – кнопки смещения на 1 страйк вверх/вниз