

リスク管理シミュレーション

N225 Option Delta Hedge Simulation								Simulation		
		Position	Mochine	Price	MTM	Strike	Fee	No Change	Brake Even I	Brake Even t
PUT	Mar-09 700P	1,000	175	200	24,790	7,000	210		6,480	9,080
Delta	N225 Future	200	8,200	8,115	-17,210		210	-192,210	1,000	1,000
	Delta	12		At Now	7,580					
CALL	Feb-09 850C	-2,000	160	145	29,790	8,500	210		8,500	9,395
Delta	N225 Future			8,115	0		0	320,000	320,000	-1,470,000
	Delta	-545		At Now	29,790					
CALL	Feb-09 875C	2,000	85	80	-10,210	8,750	210		8,500	9,395
Delta	N225 Future	0		8,115	0		0	-170,000	-170,000	1,120,000
	Delta	294		At Now	-10,210					
		Position	Mochine	Price	MTM	Strike	Fee		Brake Even I	Brake Even t
PUT	Mar-09 700P	1,000	175	200	24,790	7,000	210		6,740	9,010
CALL	Feb-09 875C	1,000	85	80	-5,210	8,750	210	-260,420	-420	-420
	Delta	-40		At Now	39,160					

※実際にプロが使用しているものをお渡します。

リスク管理シート

Risk Management Sheet									
	-1000	-600	-400	-200	ATM	200	400	600	1000
N225 (+-)	7,115	7,515	7,715	7,915	8,115	8,315	8,515	8,715	9,115
Vol sprd	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Delta-C	-0.06	-0.44	-0.89	-1.50	-2.05	-2.21	-1.68	-0.38	3.68
Delta-P	-4.28	-3.15	-2.65	-2.21	-1.82	-1.49	-1.21	-0.97	-0.61
Delta	-4.34	-3.58	-3.55	-3.71	-3.87	-3.70	-2.89	-1.34	3.07
Gamma	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Vega	8.60	7.39	6.30	5.37	5.19	6.16	8.06	10.12	11.38
days Theta	-6.69	-4.12	-1.71	0.32	0.18	-3.43	-10.09	-17.46	-23.90
Call	1	7	21	52	114	224	399	651	1,393
Put	454	306	248	200	159	126	99	78	47
Pos(Call)	-1	-9	-22	-45	-81	-125	-165	-187	-124
Pos(Put)	454	306	248	200	159	126	99	78	47
Net Delta	-2.34	-1.58	-1.55	-1.71	-1.87	-1.70	-0.89	0.66	5.07

※実際にプロが使用しているものをお渡しします。

プレミアム・マトリックス

	input											
Expiry	2月12日	tau	0.027	期日								
N225	8,165	Mar-09	8,115	3月12日								
Vol	55	現物	8251.2									
Strike	8000											
V sprd	1											
S sprd	100											
N225 Option Matrix												
Call	7565	7665	7765	7865	7965	8065	8165	8265	8365	8465	8565	8665
45	75.9	102.5	135.2	174.3	220.1	272.5	331.6	396.9	467.9	544.2	625.1	709.9
46	79.8	106.9	140.0	179.4	225.3	277.8	336.7	401.7	472.4	548.3	628.7	713.1
47	83.7	111.3	144.8	184.5	230.6	283.1	341.9	406.6	477.0	552.4	632.4	716.3
48	87.7	115.8	149.7	189.6	235.8	288.3	347.0	411.6	481.6	556.6	636.1	719.6
49	91.7	120.3	154.5	194.7	241.1	293.6	352.2	416.5	486.2	560.9	639.9	722.9
50	95.8	124.8	159.4	199.8	246.4	298.9	357.4	421.5	490.9	565.1	643.8	726.3
51	99.9	129.3	164.3	205.0	251.6	304.2	362.5	426.4	495.6	569.5	647.7	729.8
52	104.1	133.9	169.1	210.1	256.9	309.4	367.7	431.4	500.3	573.8	651.7	733.3
53	108.2	138.5	174.0	215.2	262.1	314.7	372.9	436.4	505.0	578.2	655.7	736.9

日経平均先物とボラティリティによるマトリックス。
 Inputのところ、権利行使日、中心となる日経平均の値、ボラティリティの中心値、行使価格、ボラティリティの変化幅、日経平均の変化幅を入力して、上がコールのマトリックス、下がプットのマトリックスとなっております。

※実際にプロが使用しているものをお渡しします。