

- - ;
- - ;
- - ;
- (type options) - , /;
- (type total) - .

, Ctrl Shift, .

:

-
-
-
-
-
-

Positions																								
Accounts		Strategies		Positions	Fills	Orders	Notes	What-if	Market	Chart	Set price													
CQG_DEMOITG181 T		ES		Test_strategy	actual	r/o																		
				Q	Instrument	Type	Strike	Exp	Positio...	Vola	Price	Volume	Last	Th...	Bid	Ask	P&L	P&L (M)	ΣDelta	ΣGam...	ΣVega	ΣTheta		
Test_strategy																								
				✗	✓	-1	CME ES FC U17 2150	call	2150.00	360	M	16...	129.7...	-129.75	125.00	12...	12...	128...	2.88	145.00	-0.50	-0.001...	-8.40	0.20
				✗	✓	0	CME ES FP U17 2150	put	2150.00	360	M	16...	0	0.00	154.25	15...	15...	153...	0.00	0.00	0.000000	0.00	0.00	
				✓	1	CME ES FC U17 2160	call	2160.00	360	R	16...	120...	120.00	119.25	1...	1...	12...	1...	57.50	0.49	0.001...	8.39	-0.19	
				✓	3	CME ES FC U17 2110	call	2110.00	360	R	17...	152...	457.50	149.25	1...	1...	15...	-3...	-170.00	1.63	0.003...	25.04	-0.61	
				✗	✓	3	CME ES FP U17 2110	put	2110.00	360	R	16...	137...	412.75	138.75	1...	1...	13...	-2...	-110.00	-1.37	0.003...	25.04	-0.58
				✗	0		options					0.0...	143.4...	860.50		0...	84...	868...	-1...	-77.50	0.25	0.006584	50.08	-1.19
				✗	0		total					0.0...	143.4...	860.50		0...	84...	868...	-1...	-77.50	0.25	0.006584	50.08	-1.19

1 -

- :
- ;
 - ;
 - Q - ;
 - Instrument - ;
 - Type - : call (), put (), fut ();
 - Strike - ;
 - Position type - (R - , M -);
 - Exp. - - ;
 - Vol - ;
 - Price - ;
 - Last price - ;
 - Theo - ;
 - P&L - / ;
 - Theta, Vega, Gamma, Delta - ().
 - Volume - . (), ;
 - P&L (M) - / ;
 - Bid/Ask - Bid/Ask ;
 - Mnns (moneyness,) - :
 - I - (in the money),
 - A - (at the money),
 - O - (out of the money).

, :

- c .
- .

Position type, :

- R - .
- M - , .

4 –

-  – ();
-  – / ();
-  – ;
- **Shift** – (.)
- **Instrument** – :
 -  – ;
 -  – ();
 -  – / ();
 -  – ();
 -  – ();
 - :
 - (Option desk);
 - (Volatility skew);
 - (Pricing model);
 - (Spread desk).
 -  – ;
 -  – .

, . . .

:

- **Add position** /;
-  .

Add position :

1. ;



Add new position



Account

Account1



Strategy

Strategies1



Instrument

AAPL

Price

115,03




Quantity

4




OK

Cancel

5 –

2. ;



, . . .

3. ;

4. ;

5. ();

6. OK.

, , [Spread desk](#) (. 10).

The screenshot shows a trading interface with a 'Drop' button highlighted by a red circle and an arrow. Below it is a dialog box titled 'Add new position' with fields for Account, Strategy, Instrument, Price, and Quantity. To the right is a table of market data for GOOG / GOOG 2015-06-12.

Th...	Ve...	Ga...	De...	Ask	T...	Bid	Vola	Po...	St...	Po...	Vola	Ask	T...	Bid	De...	Ga...	Ve...	Th...
-0,...	0,11	0,...	0,83	13...	13...	13...	30...		53...		30...	1.28	1.20	1.13	-0,...	0,...	0,11	-0,...
-0,...	0,13	0,...	0,77	11...	11...	11...	30...		53...		30...	1.74	1.72	1.72	-0,...	0,...	0,13	-0,...
-0,...	0,15	0,...	0,71	9.33	9.30	9.24	30...		53...		30...	2.41	2.38	2.38	-0,...	0,...	0,15	-0,...
-1,...	0,16	0,...	0,64	7.61	7.63	7.56	30...		54...		30...	3.29	3.22	3.19	-0,...	0,...	0,16	-1,...
-1,...	0,17	0,...	0,56	6.18	6.15	6.04	30...		54...		30...	4.30	4.24	4.26	-0,...	0,...	0,17	-1,...
-1,...	0,17	0,...	0,49	4.89	4.86	4.75	30...		54...		30...	5.48	5.45	5.42	-0,...	0,...	0,17	-1,...
-1,...	0,17	0,...	0,41	3.83	3.76	3.66	30...		54...		30...	6.92	6.85	6.84	-0,...	0,...	0,17	-1,...
-1,...	0,16	0,...	0,34	2.89	2.85	2.74	30...		55...		30...	8.51	8.44	8.47	-0,...	0,...	0,16	-1,...

6 –

Add new positions (. . 6). , drag'n'drop: – call, – put.

Enter.



/Fill manager

[Fill manager](#) **default.**

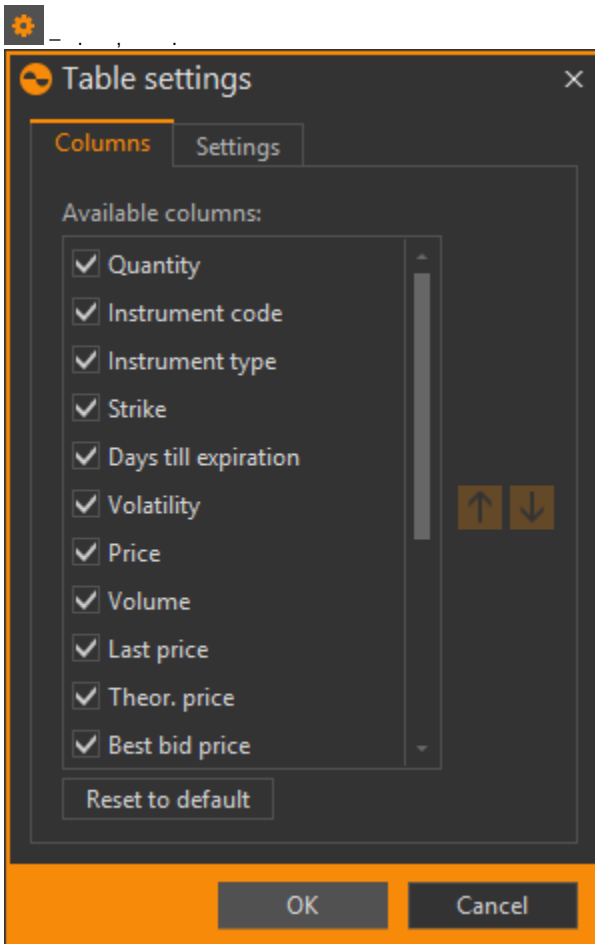
[Fill manager](#) .



.

actual .

, , / (total options). .



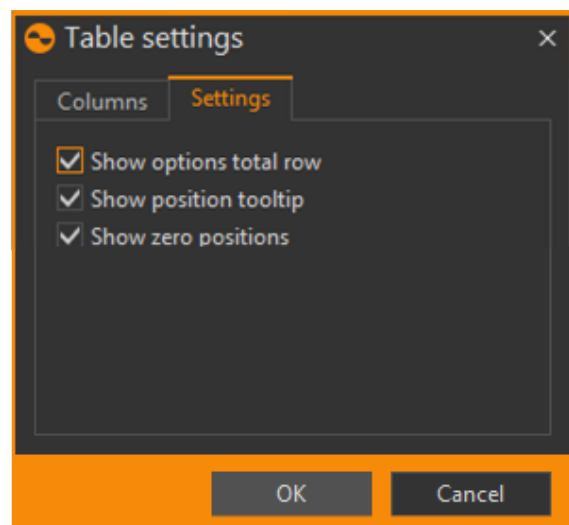
12 –



, Reset to default.

Setting :

Vola	Last	Ask
460,7811	0,05	0,05
214,1922	0,05	0,05
0,0000		0,05
0,0000		0,05



13 – Table settings

- Show options total row – ;

Positions																Chart		Set price		DOL		ΣDelta		ΣGamma		ΣVega		ΣTheta	
Q	Instru...	Type	Strike	Exp	Vol	Price	Vol...	Last	Theo	Bid	Ask	P&L	P&L (M)	ΣDelta	ΣGamma	ΣVega	ΣTheta												
Test strategy																													
-2	CME...	put	4470.0	1	26,2665	51,25152	-10...	51,75	51,25152	0	0	0	0	1,36	-0,009539	-2,0447	17,7268												
0	CME...	put	4410.0	1	20,9198	0	-3	18,75	13,59224	13,25	14,75	3	60	0,00	0,000000	0,0000	0,0000												
1	CME...	put	4390.0	1	22,0734	10	10	8,88434	8,75	9,75	-1,11566	-22	-0,24	0,004909	0,8842	-6,4422													
1	CME...	call	4440.0	1	19,1620	13,25	13,25	13,25	19,0971	18,75	20,25	5,8471	117	0,46	0,007253	1,1341	-7,1728												
1	CME...	put	4440.0	1	19,4855	31,5	31,5	25,214	24,75	26,5	-6,286	-126	-0,54	0,007133	1,1343	-7,2952													
3	CME...	call	4380.0	1	13,5773	0	0	55,75	55,64078	0	0	166,92233	3338	2,76	0,011392	1,2622	-5,6564												
0	opt...				0,0000	-12,68826	-50...	0	52,25	56,5	168,36778	3367	3,81	0,021148	2,3701	-8,8399													
0	total				0,0000	-12,68826	-50...	0	52,25	56,5	168,36778	3367	3,81	0,021148	2,3701	-8,8399													

- 14 – options total row
- Show position tooltip – ;

Q	Instru.	Type	Strike	Exp	Posit...	Price	Volume	Last	Th...	Bid	Ask	P&L	P&L (M)	ΔDelta	ΣGam...	ΣVega	ΣTheta
-7	CME ES FC U17 2150	call	2150.00	-	360	M	76...	128,75	128,00	12...	128...	2,88	145,00	-0,50	-0,001...	-0,40	0,00
0	CME ES FP U17 2150	put	2150.00	-	360	M	76...	0	0,00	154,25	15...	152...	0,00	0,00	0,000000	0,00	0,00
1	CME ES FC U17 2160	call	2160.00		360	R	EQG_DEMOITG181 / Test_strategy / CME ES FC U17 2110	12...	7...	57,50	0,49	0,001...	6,39	-0,19			
3	CME ES FC U17 2110	call	2110.00		360	R	Can be edited?	Yes		11...	-2...	-178,00	1,61	0,001...	25,04	-0,61	
3	CME ES FP U17 2110	put	2110.00		360	R	Affects calculations	Yes		13...	-2...	-118,00	-1,37	0,001...	25,04	-0,58	
0	options						Price	129,75		360...	-1...	-77,50	0,25	0,006384	50,08	-1,19	
0	total						Volume	-128,75									
							Volatility	16,8427									
							Last price	125,00									
							Theor. price	126,07									
							Best bid price	125,75									
							Best ask price	126,25									
							Profit/Loss	2,07885									
							Profit/Loss (money)	145									
							Margin	0,0000									
							Position delta	-0,50									
							Position gamma	-0,00112555									
							Position vega	-0,3952									
							Position theta	0,1862									
							Instrument	CME ES FC U17 2110									
							Strike	2110,0									
							Expiration date	15 Sep 2017									
							Days till expiration	360									
							Contains external fills	No									
							Contains manual fills	Yes									
							Contains adjustment fills	Yes									

- 15 –
- Show zero positions – ;

Q	Instru.	Type	Strike	Exp	Posi...	Vol	Price	Volume	Last	Theo	Bid	Ask	P&L	P&L (...)	ΔDelta	ΣGam...	ΣVega	ΣTheta
0	CME ES FC H...	call	21	189	M	14,52...	0	0,00	82,50	76,75	76,00	77,00	0,00	0,00	0,00	0,0000...	0,00	0,00
0	CME ES FC U...	call	50	7	M	534,6...	0	0,00	1677,50	1656,37	1667,25	1672,25	0,00	0,00	0,00	0,0000...	0,00	0,00
0	CME ES FP H...	put	21	189	M	14,71...	0	0,00	98,75	105,63	105,25	106,25	0,00	0,00	0,00	0,0000...	0,00	0,00
0	opt...					0,0000	0	0,00		0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,00	0,00	0,0000...	0,00	0,00
0	total					0,0000	0	0,00		0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,00	0,00	0,0000...	0,00	0,00

- 16 –