# **Options Evaluator**

Options Evaluator è un tool che permette di rappresentare graficamente le greche di un opzione in base ai parametri impostati dall'utente. La rappresentazione grafica può essere in 2D o in 3D.



#### Parameters

![](_page_0_Figure_5.jpeg)

Di seguito l'elenco dei parametri da imputare per la visualizzazione delle greche di un'opzione:

- Underlying Price: prezzo del sottostante;
- Options Type: tipo di opzione, Call o Put;
- Calculation Method: metodo da utilizzare per il calcolo delle greche;
- Strike: strike dell'opzione da analizzare;
- Expiry Date: data di scadenza dell'opzione da analizzare;
- Analysis Date: data dell'analisi, ovvero la data alla quale si vogliono calcolare le greche;
- Implied Volatility: volatilità implicità dell'opzione da analizzare;
- Risk-Free Rate: risk-free rate dell'opzione da analizzare.

**Options Evaluator** 

#### Results

Results			
	Option Price	0.09942	
Delta	0.51447	Gamma	1.64866
Theta	-0.00239	Vega	0.00964
Rho	0.00295	Charm	-0.00033
Vanna	-0.04823	Veta	-8.23247
Vomma	0.00004	Color	-0.00772
Speed	-0.17933	Ultima	-0.00183
Zomma	-16.4794	Time Value	0.09942

Una volta che vengono imputati i parametri la sezione Results mostra il valore di ogni greca suddivise in base alla colorazione per derivata prima, seconda e terza, ovvero greche di primo ordine, di secondo o di terzo ordine.

## Relations

Relations							
	Spot Price	Volatility	Time to Expiry				
Price	Delta	Vega	Theta				
Delta	Gamma	Vanna	Charm				
Vega	Vanna	Vomma	Veta				
Gamma	Speed	Zomma	Color				
Vomma		Ultima					

Le greche sono legate tra loro secondo le relazioni espresse nella tabella Relations. Esempio: La greca Speed rappresenta la variazione del Gamma rispetto alla variazione dello Spot Price.

## Chard 2D

![](_page_2_Figure_3.jpeg)

Sull'asse Y di sinistra viene rappresentato il valore delle greche, mentre sull'asse Y di destra troviamo il valore del prezzo dell'opzione. Per quanto riguarda l'asse X è possibile scegliere quale proprietà visualizzare utilizzando il menù, come vedremo nel paragrafo successivo.

#### ll menù

![](_page_2_Figure_6.jpeg)

Paramet	er	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse X, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Minimum	nimum Value permette di scegliere il valore minimo dell'asse X, in funzione della proprietà so	
Maximur	Maximum Value permette di scegliere il valore massimo dell'asse X, in funzione della proprietà scelta	
Q Cross Hair	permette di abilitare o disabilitare il Crosshair per il grafico 2D	
Save as Image	permet L'imma	te di salvare il grafico 2D attualmente in uso in formato immagine (*.png). gine verrà salvata nella cartella Immagini di beeTrader, nei Documenti dell'utente

![](_page_3_Picture_2.jpeg)

permette di stampare il grafico 2D attualmente in uso. Funzione disponibile se sul pc in uso è presente una stampante

## Chart 3D

![](_page_3_Picture_5.jpeg)

#### ll menù

![](_page_3_Picture_7.jpeg)

X-Axis	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse X, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Depth Axis	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse Depth, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Y-Axis	permette di scegliere la greca da visualizzare sull'asse Y come risultante delle proprietà scelta sull'asse X e Depth, tra Options Price, Delta, Gamma, Theta, Vega, Rho, Vanna, Charm, Speed, Zomma, Color, Veta, Vomma, Ultima, Time Value
Minimum	permette di scegliere il valore minimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta
Maximum	permette di scegliere il valore massimo dell'asse X o Depth, in funzione della proprietà scelta

×

Rotate	
una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile zoommare la superficie muovendo il mouse	
una volta attivato e premendo e tenendo premuto il pulsante sinistro del mouse è possibile spostare la superficie muovendo il mouse	
permette di azzerare tutte le modifiche grafiche e tornare alla vista iniziale Reset Zoom & Pan	

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

Permanent link: http://manuals.playoptions.it/Iceberg\_old/it/options\_evaluator?rev=1472558884

Last update: 2016/08/30 14:08