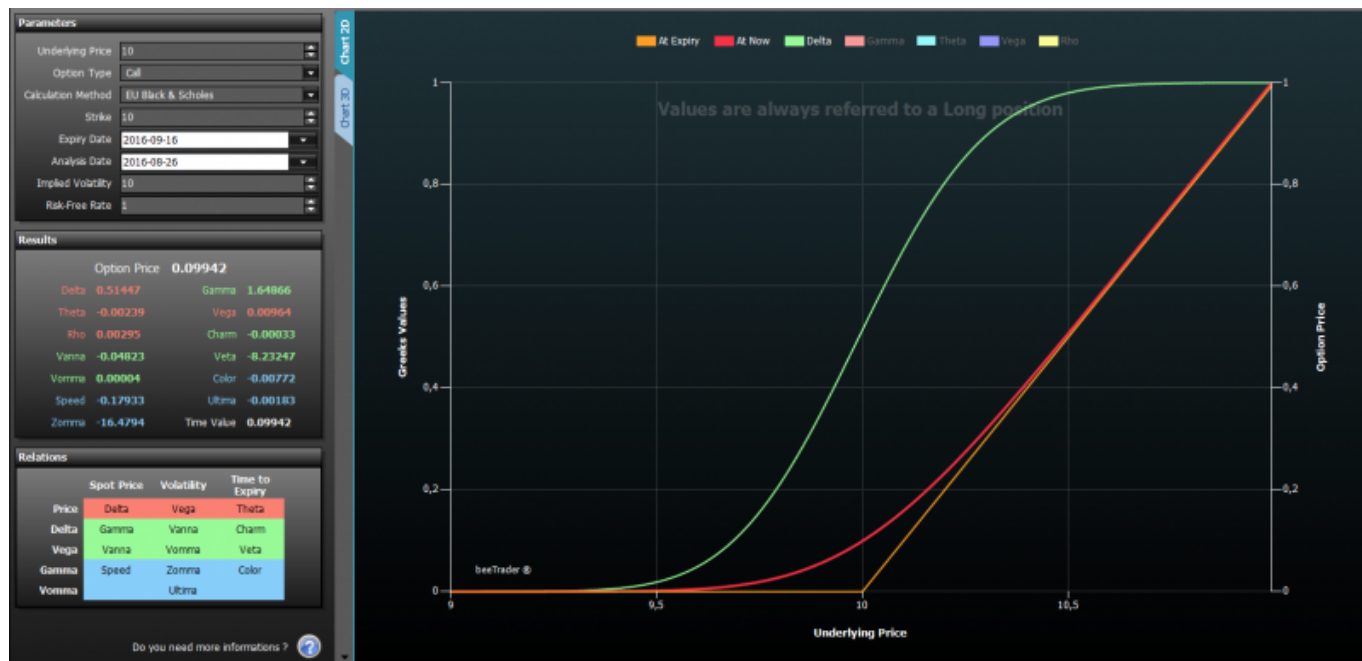


Options Evaluator

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

Parameters

Underlying Price: 10

Option Type: Call

Calculation Method: EU Black & Scholes

Strike: 10

Expiry Date: 2016-09-16

Analysis Date: 2016-08-26

Implied Volatility: 10

Risk-Free Rate: 1

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 implicita dell'opzione da analizzare;
- Risk-Free Rate: risk-free rate dell'opzione da analizzare.

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 (color corallo), seconda (color verde) e terza (color azzurro), ovvero greche di primo ordine, di secondo o di terzo ordine.

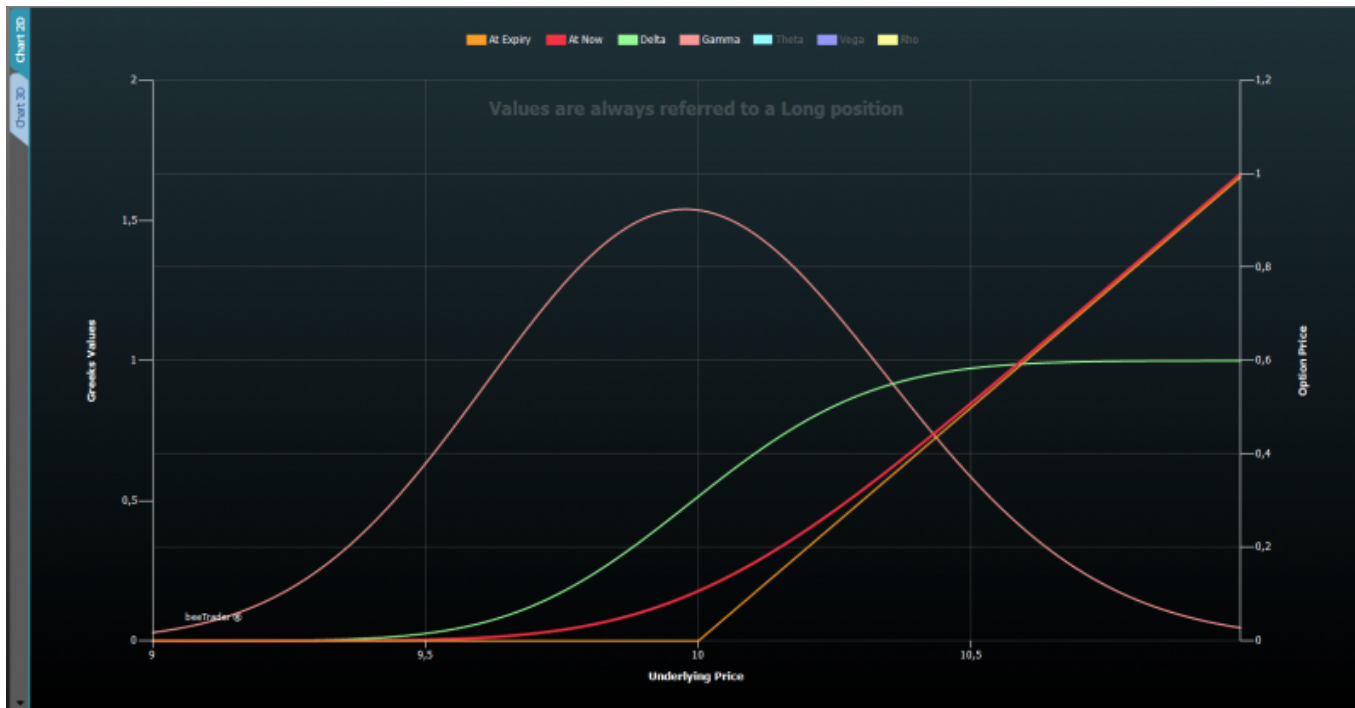
Relations

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.

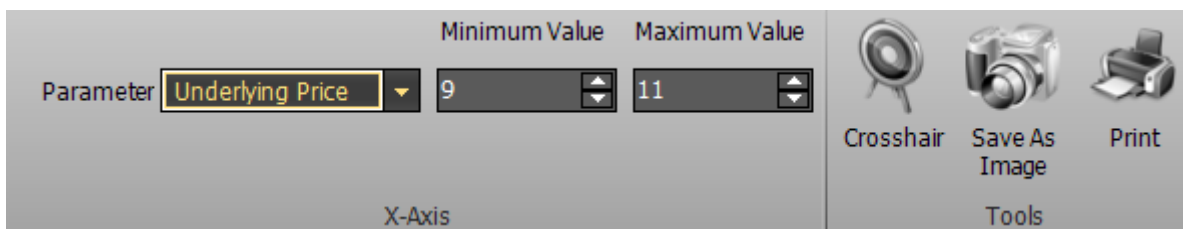
Le greche sono suddivise in base alla colorazione per derivata prima (color corallo), seconda (colore verde) e terza (colore azzurro), ovvero greche di primo ordine, di secondo o di terzo ordine.



Chard 2D



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.

Il menù

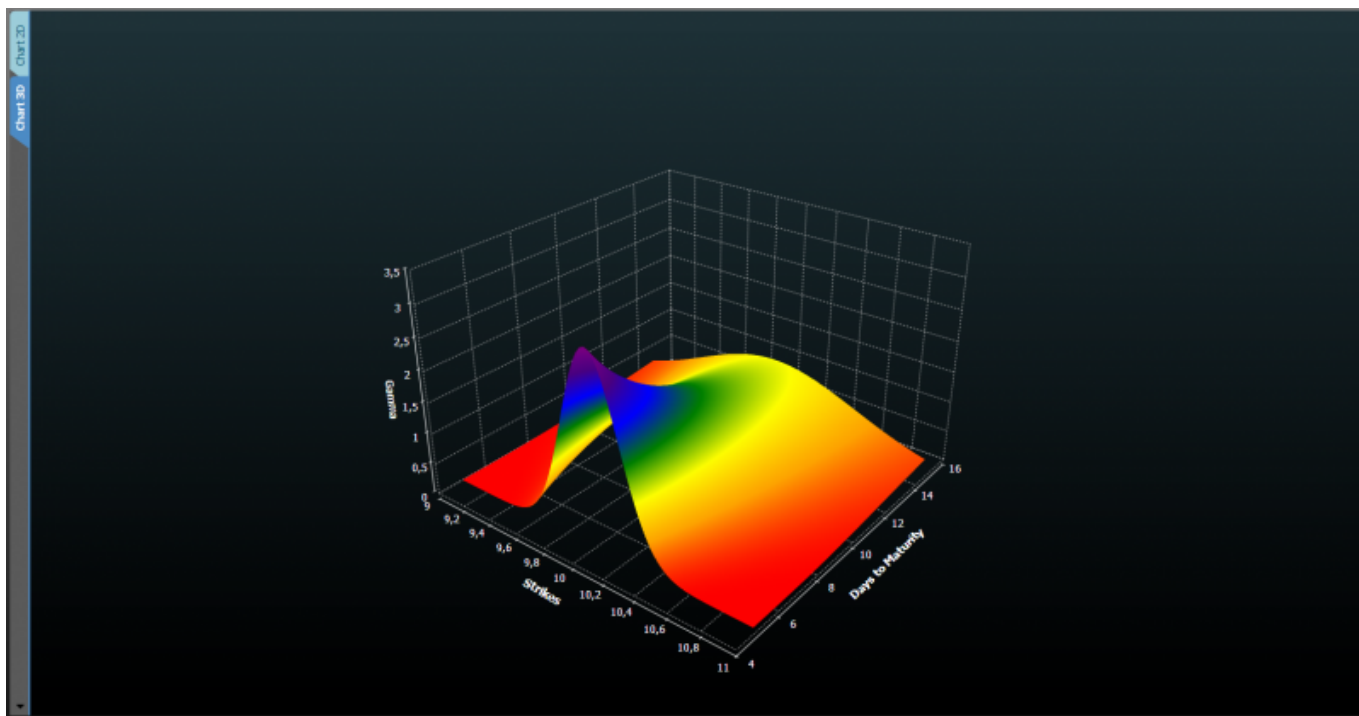


Parameter	permette di scegliere la proprietà da visualizzare sull'asse X, tra Underlying Price, Time to Expiry, Volatility, Risk-Free Rate
Minimum Value	permette di scegliere il valore minimo dell'asse X, in funzione della proprietà scelta
Maximum Value	permette di scegliere il valore massimo dell'asse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



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

Chart 3D







Il menù

X-Axis	Underlying Price	Minimum	9	Maximum	11	Calculate Default Rotate Zoom Pan Reset Zoom & Pan
Depth Axis	Volatility	Minimum	5	Maximum	15	
Y-Axis	Gamma					

Parameters Surface

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

From:

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

Permanent link:

http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/it/options_evaluator?rev=1472559118



Last update: **2016/08/30 14:11**