

Rapport d'Analyse d'Option

Paramètres:

Sous-jacent: 100.0

Strike: 100.0

Maturité: 1.0 ans

Taux sans risque: 5.0%

Volatilité: 20.0%

Type d'option: Call

Résultats:

Prix Black-Scholes: 10.45

Prix Monte Carlo: 10.45

Grecques:

Delta Call: 0.6368

Gamma: 0.0188

Vega: 37.5240

Theta Call: -6.4140/jour

Rho Call: 53.2325%/point

