

Идеальная бабочка



СТРАТЕГИЯ ПОКУПКИ БАБОЧКИ НА
ИНДЕКС RTS
С ПОСЛЕДУЮЩЕЙ РЕГУЛИРОВКОЙ

Советы о том, как можно регулировать купленную бабочку при движении рынка в ту или иную сторону.

Торговый план

- Время входа за 25-30 дней до экспирации
- Входим 50% капитала
- Регулирование

Цель по прибыли +15%-20%

$$5500 * 0,20 = 1100$$

Максимальные потери 15%

$$5500 * 0,15 = 825$$

Бабочка на индекс РТС

15.06.2010

Цена 138500

	Июль (30)		
Опционы	Премия	Дельта	Кол-во
Call 125000	15700	0,80	1
Call 140000	5700	0,48	-2
Call 155000	1200	0,16	1

Дельта	0,00
Гамма	0
Тэта	68
Вега	-110

Дебит

5500 п.

Графический профиль позиции на 15.06.2010 при цене 138500

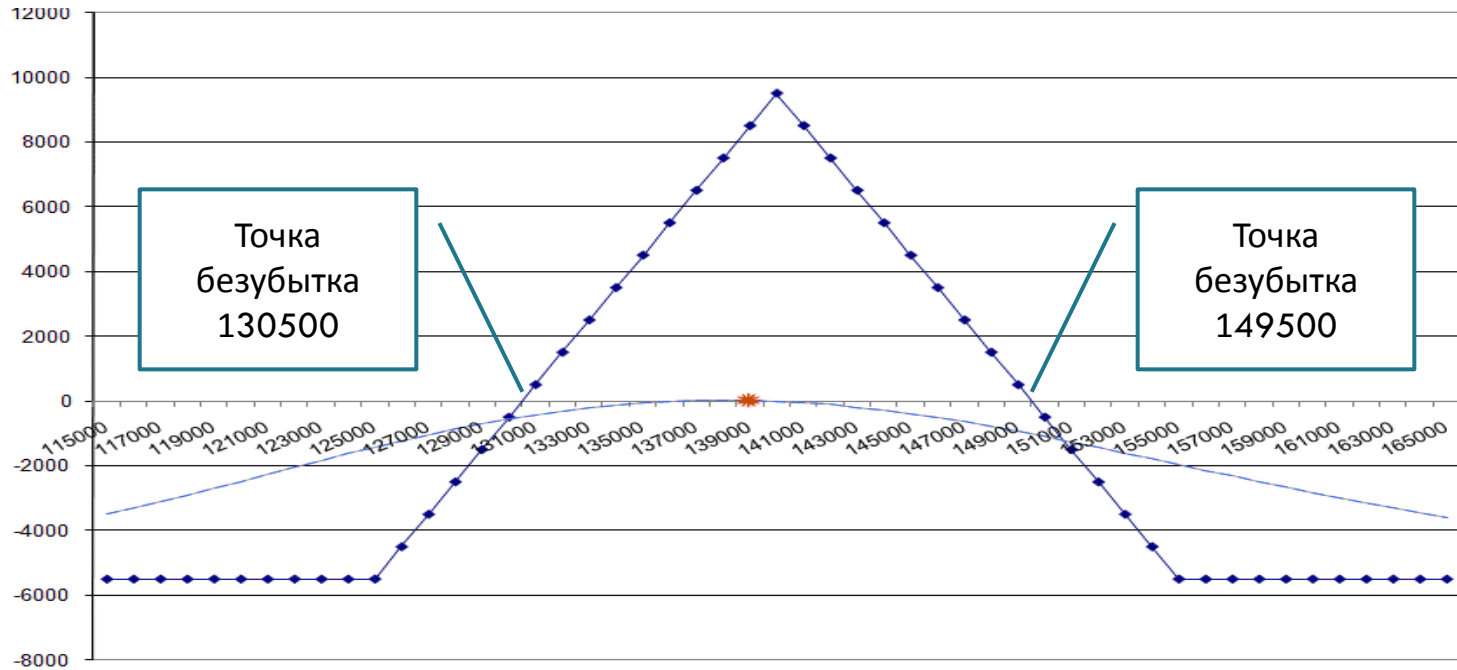
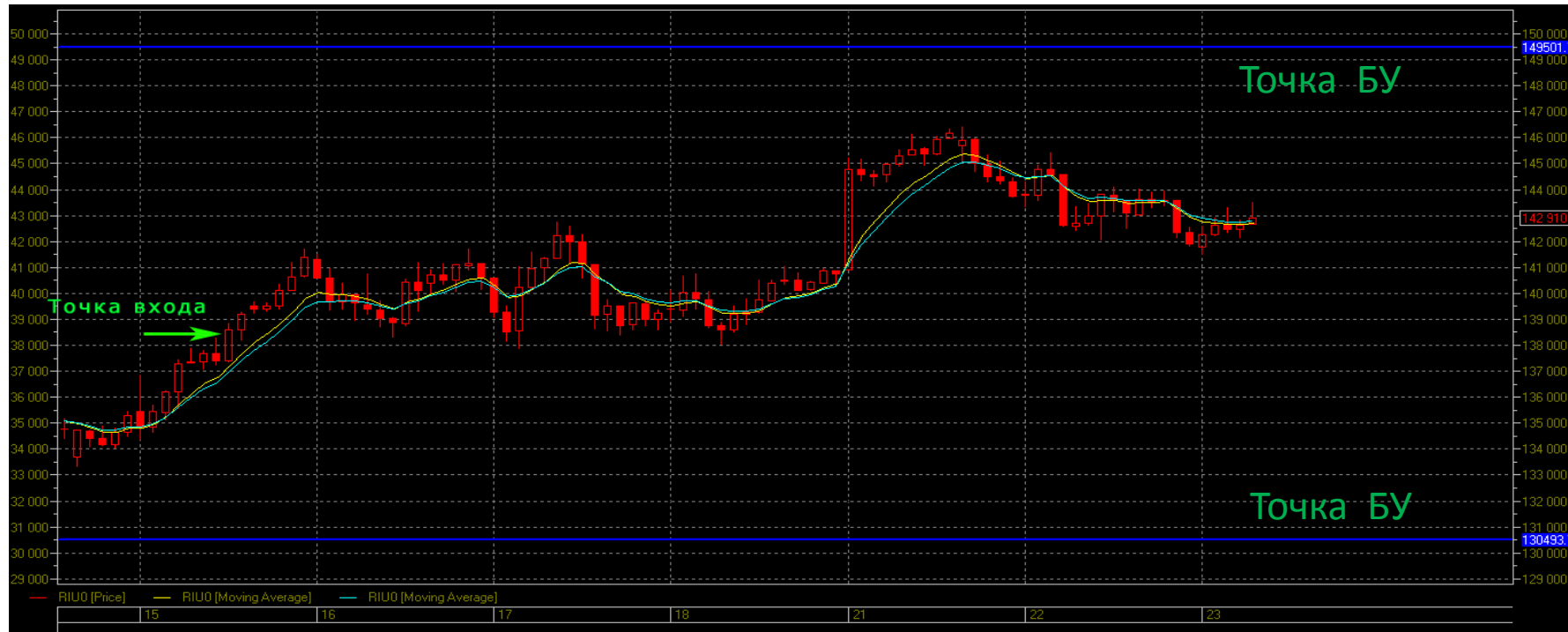
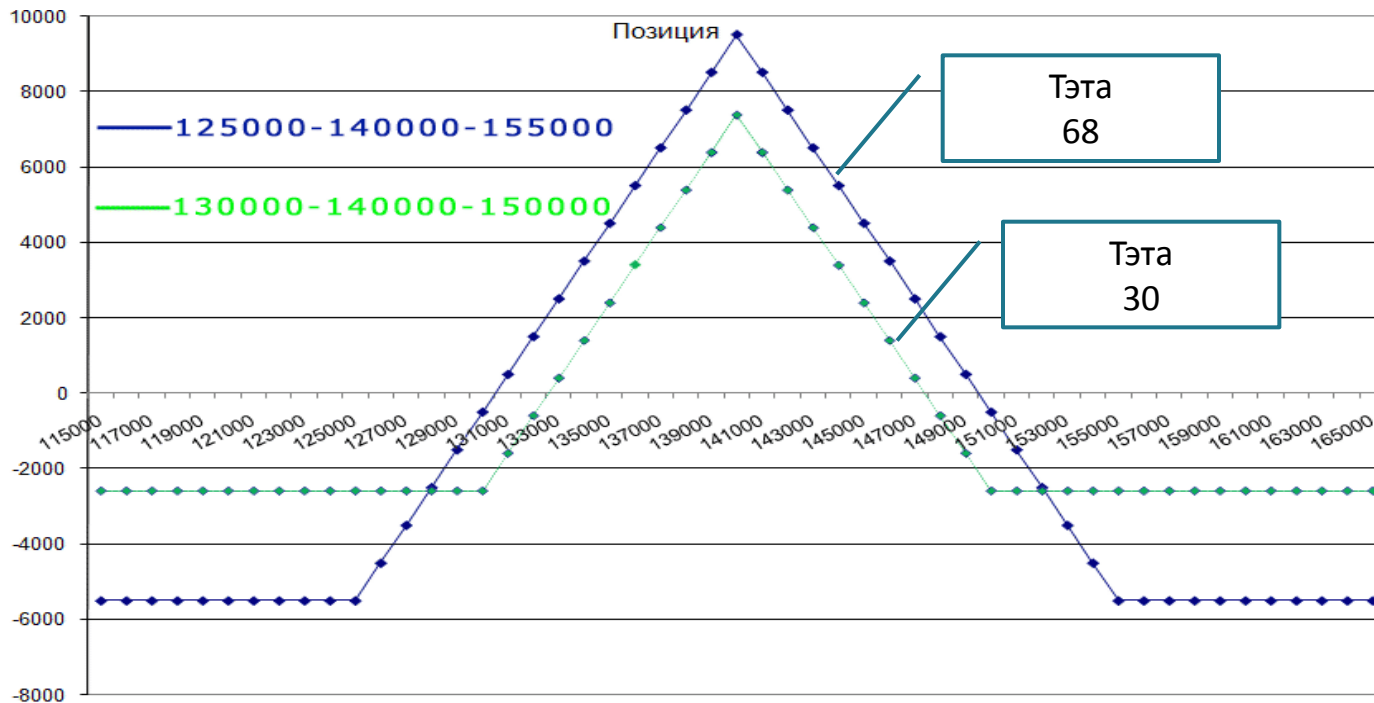


График цены фьючерса на индекс РТС 60 мин.



Сравнение двух позиций



Сравнение двух позиций

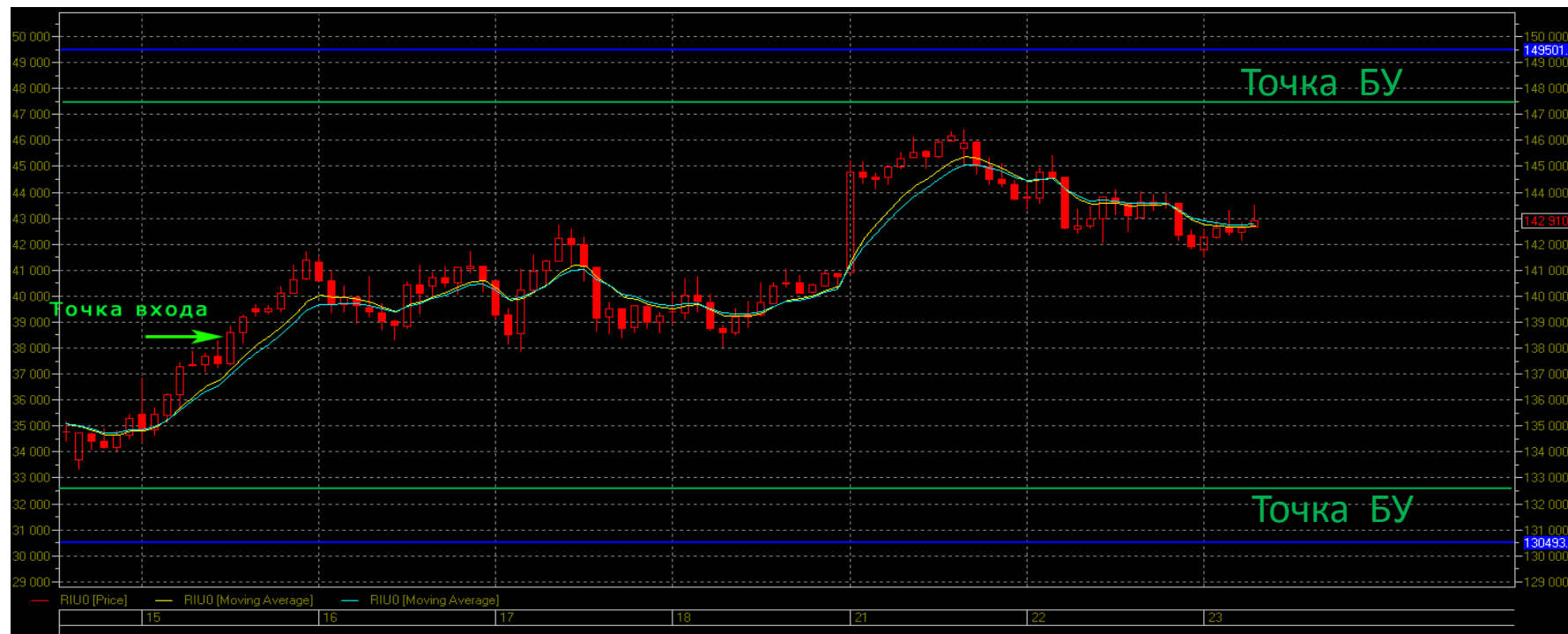
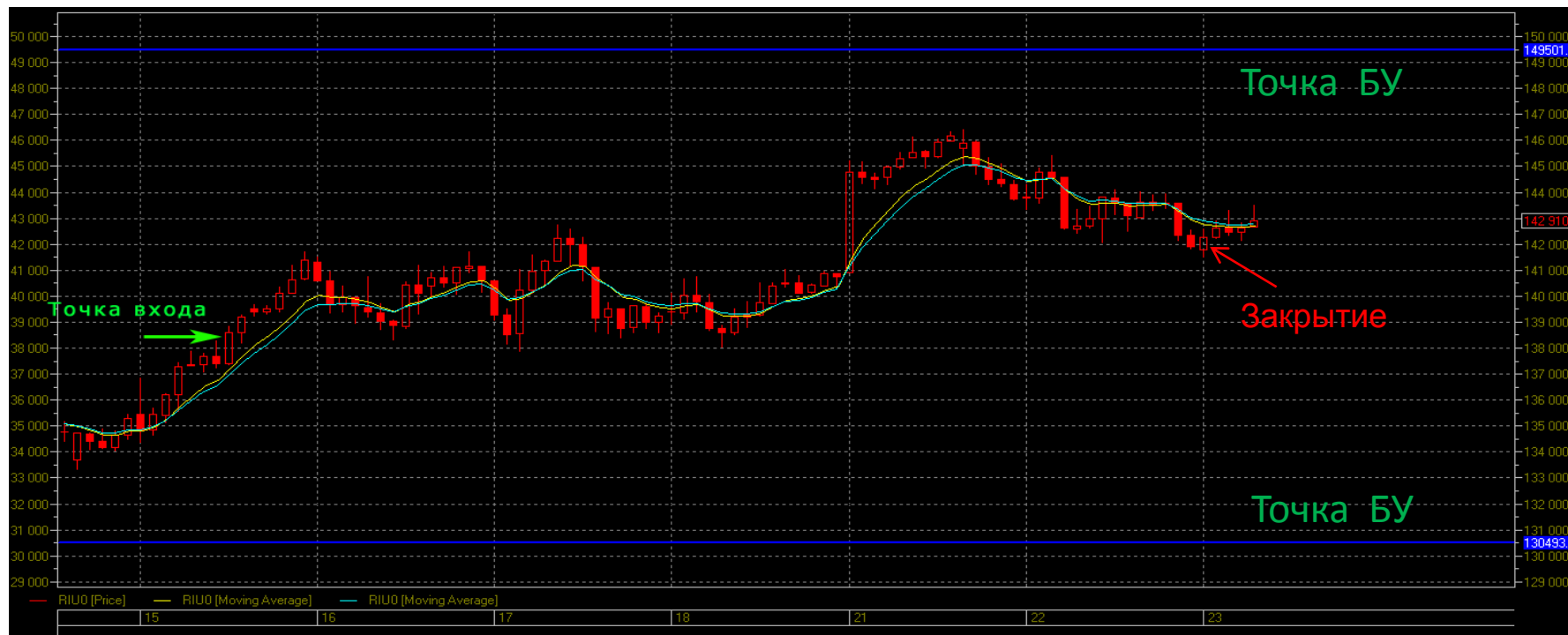
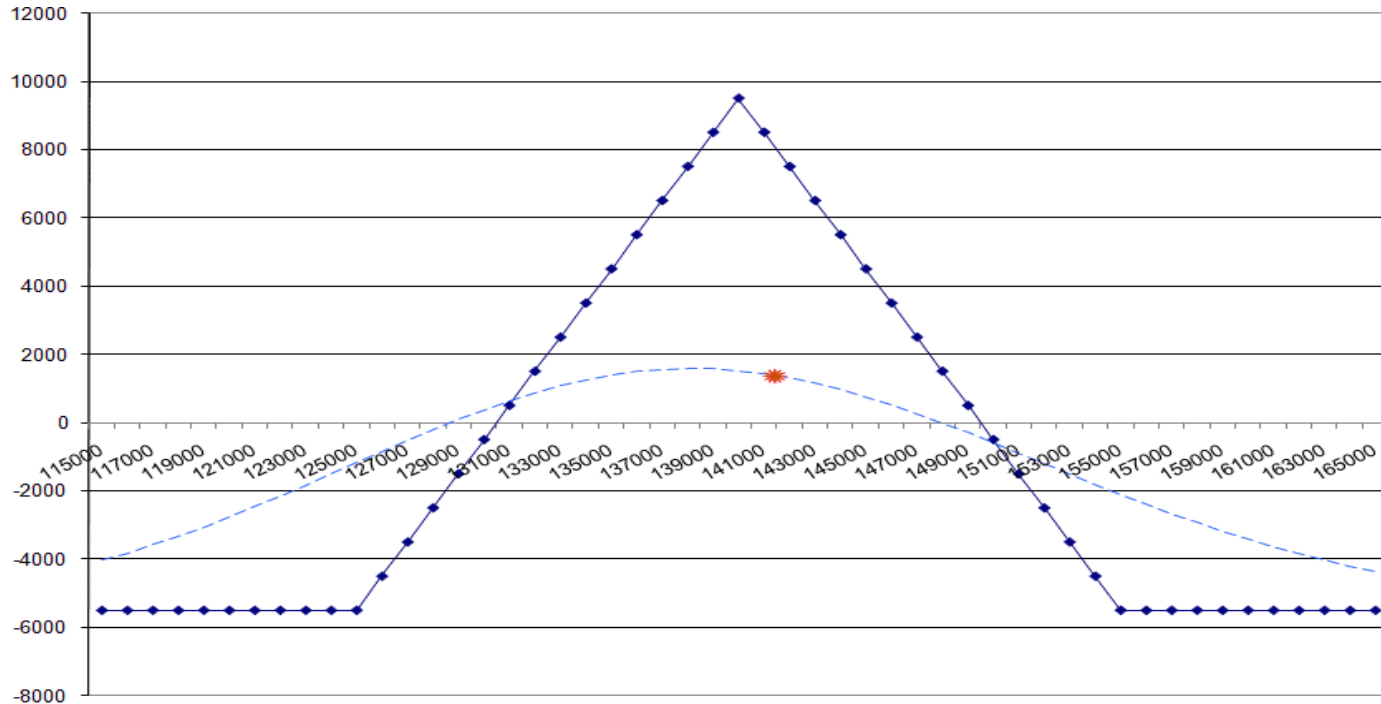


График цены фьючерса на индекс РТС 60 мин.



Заккрытие позиции

23.06.2010 Цена 141600



Заккрытие позиции

23.06.2010 цена 141 600

	Июль (22)				ИТОГО:	
Опционы	Премия	Кол-во	Премия	Заккрытие	Максимальный дебет	5500 п./3448,34руб.
Call 125000	15700	1	17500	-1	Прибыль/ убыток	+1550 п./920 руб.
Call 140000	5700	-2	5550	2	Доход от общего дебита в пунктах	+28%
Call 155000	1200	1	650	-1	Доход от общего дебита в рублях	+27%

Итого прибыль 1550 п.

Результаты:

