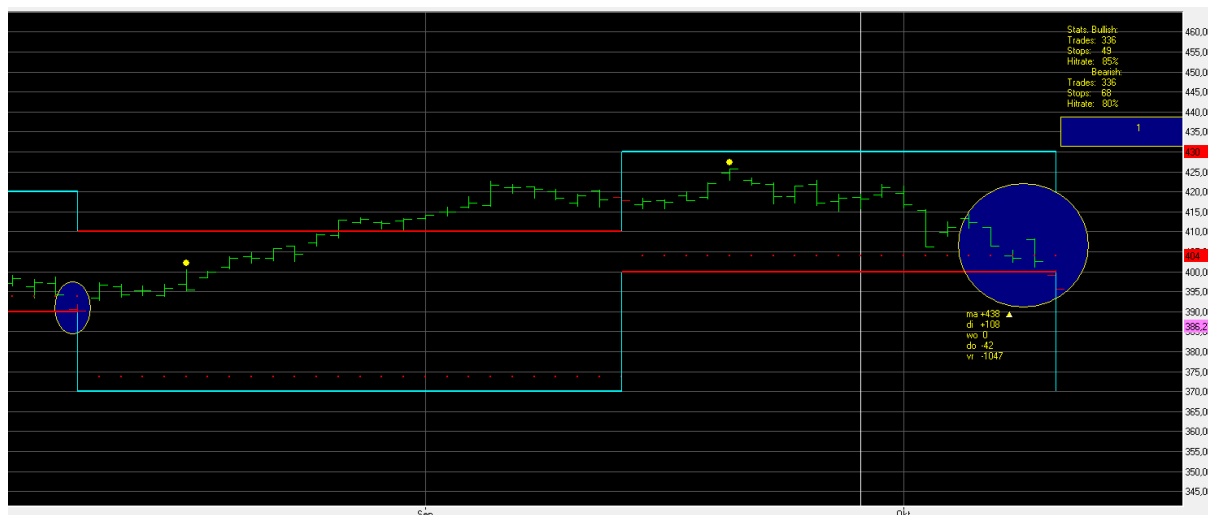




11-10-2014 Ledenspecial **Short strangle strategie** **nieuwe maatregel "invoering waarschuwningsniveau"**



Het is niet de eerste keer dat we helaas op de laatste dag worden geconfronteerd met een behoorlijk verlies in de optie portefeuille. In de vorige ledenspecial had ik al geconstateerd dat ondanks een mooi rendement over de gehele tijdsperiode (namelijk **+136%** op dat moment), de verhouding winst/verlies voor mij niet naar tevredenheid was. We zullen dus iets moeten doen om de verliezen meer in de hand te houden.

Resultaten afgelopen week

Afgelopen week waren de resultaten per dag van de AEX oktober serie als volgt:

ma 06-10-2014: **+€438** (slotkoers AEX 412,24)

di 07-10-2014: **+€108** (slotkoers AEX 406,51)

wo 08-10-2014: **+0** (slotkoers AEX 403,46)

do 09-10-2014: **-€42** (slotkoers AEX 402,66)

vr 10-10-2014: **-1047** (slotkoers AEX 395,68)

Waarschuwningsniveau instellen.

Het is mogelijk om een waarschuwningsniveau in te zetten op een bepaald % vanaf de put strike.

We zien dat er nog geen verlies ontstaat in de laatste week van deze 4 weekse serie bij een AEX koers van 403,46. Dat komt zo'n beetje neer op een waarschuwningspercentage van 1% (1% van UP 400 = 4 AEX punten). Het waarschuwningsniveau wordt gepresenteerd als een rode stippellijn, zie afbeelding.

Geavanceerde order

Dat betekent dat we de geavanceerde order niet meer instellen op de UP zelf (400) maar op het waarschuwningsniveau (404)!

Conditie

De conditie wordt bereikt wanneer de AEX op laatste koers lager wordt dan 404

Order

Bestens

Voordelen

Het voordeel hiervan is weer dat de uitvoering dan weer geheel automatisch wordt.

En dat past weer bij de WeekendBeleggers doelgroep (die hadden immers door de week geen tijd).

Nadelen

Zijn er ook nadelen? Ja, door deze actie wordt de *hitrate* op de put (over de afgelopen 28 jaar) verlaagd van +85% naar +80%. Maar de verwachting is nu dat de verliezen worden beperkt!

Het gaat bij het beleggen niet alleen om de *hitrate* zoals vaker gememoreerd, maar om de combinatie *hitrate* EN winst/verlies ratio. Verliezen beperken, daar gaat het om en dan moet je soms maatregelen nemen! Laten we samen zien hoe deze nieuwe waarschuwningsmaatregel zich in de praktijk houdt?

Wat betekent dit nu voor de AEX nov serie?

Hoewel de rode stippellijn pas maandag door de indicator wordt getoond, weten we nu al dat de put op 370 staat. En weten we dus dat het waarschuwningsniveau (voorlopig) ligt op $370+1\% = 373,70$.

U stelt de geavanceerde order dus in op de waarschuwningsgrens van 373,70.

Ik zal zo dadelijk op de ledensite de instructie aanpassen op deze nieuwe maatregel voor de november serie.