

20-12-2013 Ledennieuwsbrief "3 x scheepskrom achter elkaar voor Iron Condor strategie"

Op het prima verlopen seminar van afgelopen zaterdag heb ik uitgelegd dat mijn zoon (25) nu ook voor de eerste keer meedoet met de Iron Condor strategie. En dat hij een betere belegger zal worden als hij de "pijn" van verlies voelt. Nou, daar heeft hij dan niet lang op hoeven te wachten! Eigenlijk ben IK dus heel blij met zijn eerste optie verlies (hij waarschijnlijk niet) binnen 1 week.

Want voor de derde keer achter elkaar is de AEX uit de door de indicator berekende shortrange gebroken. De vorige week ingenomen positie werd vandaag om 10:16 uur gesloten doordat de koers >390 werd verhandeld. Als u de excelsheet 0.1.3 heeft bijgewerkt (hoeft niet, mag wel), dan ziet u dat er "slechts" €180 verlies valt te verwachten bij 3 contracten. Maar dan moet de short put 360 nog wel even tot expiratedatum 17 januari 2014 waardeloos aflopen. Deze blijft derhalve in positie.

Deze optiestrategie is een aanvullende strategie op de Turboportefeuille. Vorige week was de stand van de Open posities Turboportefeuille €3215. Vandaag is de stand €6854, een positief verschil van maar liefst €3639. Logisch, want deze strategie was nu juist bedoeld voor stijging EN daling.

Het ongerealiseerd optie verlies van €180 lijkt mij daarmee ruimschoots opgevangen. Deze strategie was immers bedoeld voor een zijwaartse beweging. In de range van de komende 4 a 5 weken mag de koers beste een beetje stijgen en best een beetje dalen, maar niet fors. En dat is wat er deze week nu juist wel is gebeurd. Begint u de combinatie van deze 2 strategieën inmiddels te doorgronden?

Kortom, jammer voor zoonlief, maar echt geen drama, wordt ie nederig van.. en dat is nu precies de beleggershouding die nodig is om een succesvolle belegger te worden, waarvan acte!

						VERVOLG		START			
				Contracten		20-12-2013		13-12-2013			
				UP	Aantal	Koers	Waarde EUR	Hist. Koers	Hist. Waarde EUR	Ongerealiseerd EUR	Ongerealiseerd % EUR
Breedte range (SDV=41)											
Impliciete Volatiliteit											
Aantal contracten											
Middenkoers AEX											
Max.afw. middenkrs in %											
AEX	call	jan	2014	400	3	1,60	480,00	0,75	225,00	255,00	113,33 %
AEX	call	jan	2014	390	-3	5,30	-1590,00	1,95	-585,00	-1005,00	-171,79 %
							3,70			-750,00	
AEX	put	jan	2014	360	-3	0,00	0,00	1,90	-570,00	570,00	100,00 %
AEX	put	jan	2014	350	0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	#DEEL/0!
							0,00	1,90		570,00	
Totaal Iron Condor							3,70		-930,00	-180,00	-19,35 %
										verk. 75%	
Netto investering (bruto investering + margin)							-930,00	11550	10620,00	698	
Netto rendement maandserie									-180,00	-1,69 %	verwacht eindresultaat op formele expiratedatum

Afbeelding: Iron Condor excelsheet situatie op expiratedatum bij AEX >360.