

STRATÉGIES

Généré intégralement par OptionOptimizer©

STRATÉGIE : (01) Écart vertical du ratio 1x2, sur option de Vente

CATÉGORIE : Ratio

PERSPECTIVE DU MARCHÉ : Neutre

OBJECTIF : L'investisseur recherche soit une forte baisse de l'action sous-jacente, soit une forte augmentation de la volatilité implicite pendant la durée de vie des options.

SOMMAIRE : Le coût initial pour lancer cette stratégie est plutôt faible, et peut même obtenir un crédit, mais le potentiel de baisse peut être substantiel.

AVERTISSEMENT : En règle générale, l'assignation anticipée, qui est possible à tout moment, survient seulement lorsqu'une option de vente est fortement en jeu.

POSITION

| Volet | Achat Vente | Nbre. Cont. | C/P | Échéance | Prix de Levée | Prime | Flux Trésorerie | Cont. Total | Flux Trésorerie Strategie | Profit Max | Perte Max | Ratio R/R | Seuils Rent. |
|-------|-------------|-------------|-----|----------|---------------|--------|-----------------|-------------|---------------------------|------------|-----------|-----------|--------------|
| 1 | Sell | 2 | Put | 220121 | 84,00\$ | 2,38\$ | 475,30 \$ | 2 | | | | | |
| 2 | Buy | 1 | Put | 220121 | 86,00\$ | 3,57\$ | 357,00 \$ | 1 | 118,30 \$ | 318,00\$ | 8 082\$ | 0,04 | 80,82\$ |

