

Strategie Optionsscheine

Stop-Lose Abstand

Sobald der OS um mindestens 0.03 Fr. in der Gewinnzone notiert wird ein Stop-Lose bei 0.01 Fr. Gewinn gesetzt (Transaktionskosten miteingerechnet). Damit soll vermieden werden, dass solche OS wieder in die Verlustzone rutschen.

Die weitere Stop-Lose Strategie sieht wie folgt aus. Sie richten sich nach dem delta Wert, wobei der kleinste Abstand zwischen Stop-Lose und aktuellem Kurs 0.02 Fr. beträgt.

Der grösste Abstand beträgt 0.01 Fr.

Liste:

delta	Abstand
0-0.1	0.02 Fr.
0.2	0.04 Fr.
0.3	0.06 Fr.
0.4	0.08 Fr.
>0.4	0.1 Fr.

Dies sind Richtwerte. Ich kann jederzeit aufgrund der Charttechnik oder meines eigenen Einschätzungs-vermögen bzgl. der zukünftigen Wert-/Marktentwicklung den OS vorzeitig verkaufen. Der Stop-Lose wird wöchentlich überprüft.

Verkaufslevel Verluste begrenzen

Verluste werden folgendermassen begrenzt.

Verkaufslevel Verlust: $\text{Kaufkurs OS} - ((K/G^* + V/K^{**} + \text{"Verlust pro 0.01 Fr} + \text{Auffüllung}) / \text{Anzahl OS})$

*K/G:

Kapitalinvestition/Gesamtinvestition

Gibt an wieviel vom Gesamtinvestment im Optionsschein investiert ist. (in Prozent)

**V/K:

Verlust pro Rappen/Kapitalinvestition

Gibt an wieviel vom jeweiligen OS-Kapital bei 1 Rappen Verlust verloren geht. (in Prozent)

Auffüllung:

Differenz von "Erlaubter Verlust" und "Gesamt Verlust K/G + V/K" multipliziert mit dem K/G pro OS-Wert.

Optionsscheine: Benötigte Informationen für die Berechnung						Berechnung Verkaufslevel Verlust														
Wert	Verkaufslevel Verlust	Anzahl	Kaufkurs OS	Kapitalinvestition K	Gesamtinvestition G	Verlust pro Rp. V	K/G*	V/K**	Verluste K/G + V/K + Verlust pro Rp.	Gesamt Verlust K/G + V/K	Erlaubter Verlust 50% von G	Auffüllung	Verkaufslevel Verlust							
ABB OS 12/16 c	Fr. 0.06	6	4'000	Fr. 0.09	Fr. 360.00	Fr. 40.00	7.09%	11.11%	Fr. 105.51	Fr. 1'999.69	Fr. 2'540.00	Fr. 38.29	Fr. 143.80							
BNP OS 12/15 c	Fr. 0.05		6'000	Fr. 0.08	Fr. 480.00	Fr. 60.00	9.45%	12.50%	Fr. 165.35					Fr. 51.05						
DBK OS 12/15 c	Fr. 0.04		6'000	Fr. 0.07	Fr. 420.00	Fr. 60.00	8.27%	14.29%	Fr. 154.72						Fr. 44.67					
GLEN OS 12/15 c	Fr. 0.12		4'000	Fr. 0.18	Fr. 720.00	Fr. 40.00	14.17%	5.56%	Fr. 182.05							Fr. 76.58				
MT OS 12/15 c	Fr. 0.06		6'000	Fr. 0.09	Fr. 540.00	Fr. 60.00	10.63%	11.11%	Fr. 177.40								Fr. 57.44			
SYNN OS 12/16 c	Fr. 0.03		8'000	Fr. 0.05	Fr. 400.00	Fr. 80.00	7.87%	20.00%	Fr. 191.50									Fr. 42.54		
UHR OS 12/16 c	Fr. 0.07		8'000	Fr. 0.12	Fr. 960.00	Fr. 80.00	18.90%	8.33%	Fr. 341.42										Fr. 102.11	
BMW OS 03/16 c	Fr. 0.02		12'000	Fr. 0.05	Fr. 600.00	Fr. 120.00	11.81%	20.00%	Fr. 310.87											Fr. 63.82
MUV2 OS 06/16 c	Fr. 0.02		15'000	Fr. 0.04	Fr. 600.00	Fr. 150.00	11.81%	25.00%	Fr. 370.87											
Differenz splitten										4	Fr. 434.68									

Verkaufslevel Gewinn

Gilt nur für Werte, welche eine positive OS-Performance vorweisen (inkl. Transaktionskosten)

Bei **Nicht Erreichen** des Kursziels innerhalb des vorgegebenen Zeitraums:

- Sofortverkauf

- Verlängerung um max. 1 Monat. Dies ist nur möglich, wenn aufgrund der Charttechnik das Kursziel innerhalb dieses Zeitrahmens erreicht werden kann.

(zwingende Voraussetzungen: Kursziel liegt innerhalb des Bollinger-Bands)

Stop-Lose kommt zum Tragen, wobei folgendes gilt:

delta	Abstand
0-0.1	0.01 Fr.
0.2	0.02 Fr.
0.3	0.03 Fr.
0.4	0.04 Fr.
>0.4	0.05 Fr.

Bei **Erreichen** des Kursziels innerhalb des vorgegebenen Zeitraums:

- Sofortverkauf,
 - Verlängerung und Ausgabe neues Kursziel und Zeitfenster. Dies ist nur möglich, wenn aufgrund der Charttechnik weitere Kursgewinne möglich sind. (Einschätzung)
- Normale Stop-Lose Strategie zählt weiterhin.

Kaufargumente

- Aufgrund welcher technischen Signalen dieser Wert gekauft wird oder welches (zukünftige) Ereignis diese Kaufentscheidung herbeigeführt hat. "Ereignisse" stehen ausschliesslich im Zusammenhang mit der "High Risk"-Sparte.
 - Mittels der Analyse eine Schätzung abgeben, bis auf welches Kurs-Level der Basiswert steigen könnte und in welchem Zeitraum dies geschehen sollte. Dies wäre somit das "Verkaufslevel Gewinn", bei welchem die oben genannten Regeln gelten.
- Ungefähre Wegbeschreibung bis zum Kursziel: -
- Angaben welche Widerstände gebrochen werden müssen
 - Angaben darüber, wenn solche Widerstände nicht überwunden werden bzw. sich das allgemeine Marktgeschehen dieses Kursziel nicht zulässt.