



Il virus del dollaro

Strategist Cagalli Tiziano

Disclaimer

I pensieri e le analisi qui esposte non sono un servizio di consulenza o sollecitazione al pubblico risparmio. I suddetti servizi non sono configurabili come rapporto di consulenza né di gestione finanziaria che prevede sempre lo studio delle esigenze finanziarie del cliente e della sua propensione al rischio.

L'articolo ha valore esclusivamente informativo e chi scrive non potrà mai e in nessuna forma essere ritenuto responsabile delle conseguenze derivanti dall'uso che il lettore, in totale autonomia ed indipendenza, potrà fare dei dati ottenuti mediante la consultazione del servizio stesso.

Tutte le analisi, le valutazioni e i commenti non intendono assolutamente promuovere alcuna forma di investimento o speculazione. Sono e vogliono essere esclusivamente studi matematici applicati a valori e materiale puramente didattico.

Eccoci nuovamente in una fase di forti movimenti e di volatilità.

In queste fasi di mercato, al di là della retorica, ci vogliono concentrazione e ragionamento.

Nel video e nel PDF della settimana scorsa dicevo che le strategie che avevamo in portafoglio erano costruite con un out-look leggermente rialzista, salvo poi adeguarsi nelle varie fasi e con GRANDE attenzione alla soglia di 1,37 dell'Eurodollaro.

Gli analisti di oltreoceano, le maggiori banche d'affari ed analisti europei avevano dato come target importante 1,39 e lo consideravano lo spartiacque tra lateralità e discesa.

Come ben si è visto, sino a che il rapporto tra le due monete non è arrivato ad 1,37 non è successo quasi nulla, salvo poi trovarsi in un mercato Bear dove la componente panico e paura la fa, al solito, da padrona.

Quello che abbiamo fatto nella nostra sala operativa, e che, vedendo gli OI, hanno fatto le grandi banche è stato solo quello di pesare la parte venduta sulle Call e tenere le posizioni vendute Put sullo stesso delta ma su due gamma diversi. Cioè iniziare a fare trading di calendario.

Il risultato è e sarà di avere la possibilità di un veloce rientro dei premi e un allontanamento dei punti di pareggio inferiori. Il tutto senza aumentare contratti in vendita e /o chiudere operazioni in perdita.

Anzi, ne abbiamo approfittato per chiudere le posizioni Call che oramai avevano pochissimo valore e consolidare i guadagni che potrebbero servire, in quanto le marginazioni, in queste fasi, aumentano di molto.

NOTE: quando parlo di Put o Call vendute, intendo delle posizioni coperte, ma con theta positivo. Io sono certo, al 100% di due cose: che i prezzi si muovono e che il tempo passa. Quindi debbo affidare i miei guadagni ed il mio futuro SOLO a certezze!



Buon trading
Tiziano Cagalli

Invito chi non conosce questi strumenti a prenderne visione e magari a leggere sul mio sito (www.PlayOptions.it) la sezione didattica.

Scarica gratuitamente, per sempre, il software per costruire le tue strategie in opzioni

