

8. Hamburger Option Symposium

Veranstalter:

- Hanseatic Technical Trading Analysts e.V. (www.HTTA.de)
- Dirk Legahn, Dominikanische Republik
(www.LoroTrader.com)

Veranstaltungsort: relexa hotel Bellevue, Hamburg

Datum: 17.-18. Oktober 2020

Risikohinweis / Disclaimer

Die folgenden Inhalte inklusive der vorgestellten Strategien dienen ausschliesslich zu Informationszwecken. Sie stellen weder ein Angebot, noch eine Empfehlung zum Kauf bzw. Verkauf von Aktien oder Derivaten, wie beispielsweise Optionen, oder sonstigen Wertpapierschriften dar. Gewinne in der Vergangenheit lassen nicht auf zukünftige Gewinne schliessen. Es wird ausdrücklich darauf hingewiesen, dass Börsengeschäfte nicht für Jedermann geeignet sind.

Weder der Referent, noch die Organisatoren und Veranstalter übernehmen eine Garantie für die Richtigkeit oder Vollständigkeit der Texte, Grafiken, Stellungnahmen und Auswertungen; alle Referenten lehnen jegliche Haftung für allfällige Verluste oder Schäden irgendwelcher Art ab, die direkt oder indirekt durch die Benutzung des Inhalts entstehen.

Copyright Hinweis

Die folgenden Inhalte inklusive der vorgestellten Strategien unterliegen dem Copyright und Urhebergesetz und dürfen ohne vorherige schriftliche Genehmigung durch den jeweiligen Referenten weder ganz, noch auszugsweise veröffentlicht werden. Sämtliches Material wurde von den genannten Referenten erstellt, soweit nicht ausdrücklich darauf hingewiesen wurde.

Vortrag

Hedging mit Optionen: Der Corana-Crash-Test

Referent und Copyright©:

Dirk Legahn

E-Mail: Dirk.Legahn@yahoo.com

Agenda

- 1. zu meiner Person**
- 2. Anforderungen an einen Hedge**
- 3. Crash-Test Versuchsaufbau**
- 4. Backtest mit der TOS**
- 5. Ergebnisse**

zu meiner Person

- Studium der Ur- und Frühgeschichte mit Nebenfach Informatik an der Uni Hamburg
- arbeitete als Programmierer und Statistiker in verschiedenen Forschungsbereichen
- hauptberuflich Trader seit 2003
- 2006 bis 2014 1. Vorsitzender des Hanseatic Technical Trading Analysts e.V.
- Handelt in der USA gelistete Aktien, ETFs, Bonds und Optionen
- wohnt in der Dominikanischen Republik
- seit 2016 Zusammenarbeit mit Optionsuniversum
- Trading-Coach, Veranstalter von Trading Camps und dem Optionsymposium



Anforderungen an einen Hedge

ein Hedge soll

- Risiken minimieren
- reagieren, wenn der Versicherungsfall eintritt
- Vega positiv sein
- möglichst wenig kosten
- möglichst wenig Margin erfordern
- nicht zu kompliziert sein
- möglichst selten Reparaturstrategien erfordern.

Crash-Test Versuchsaufbau

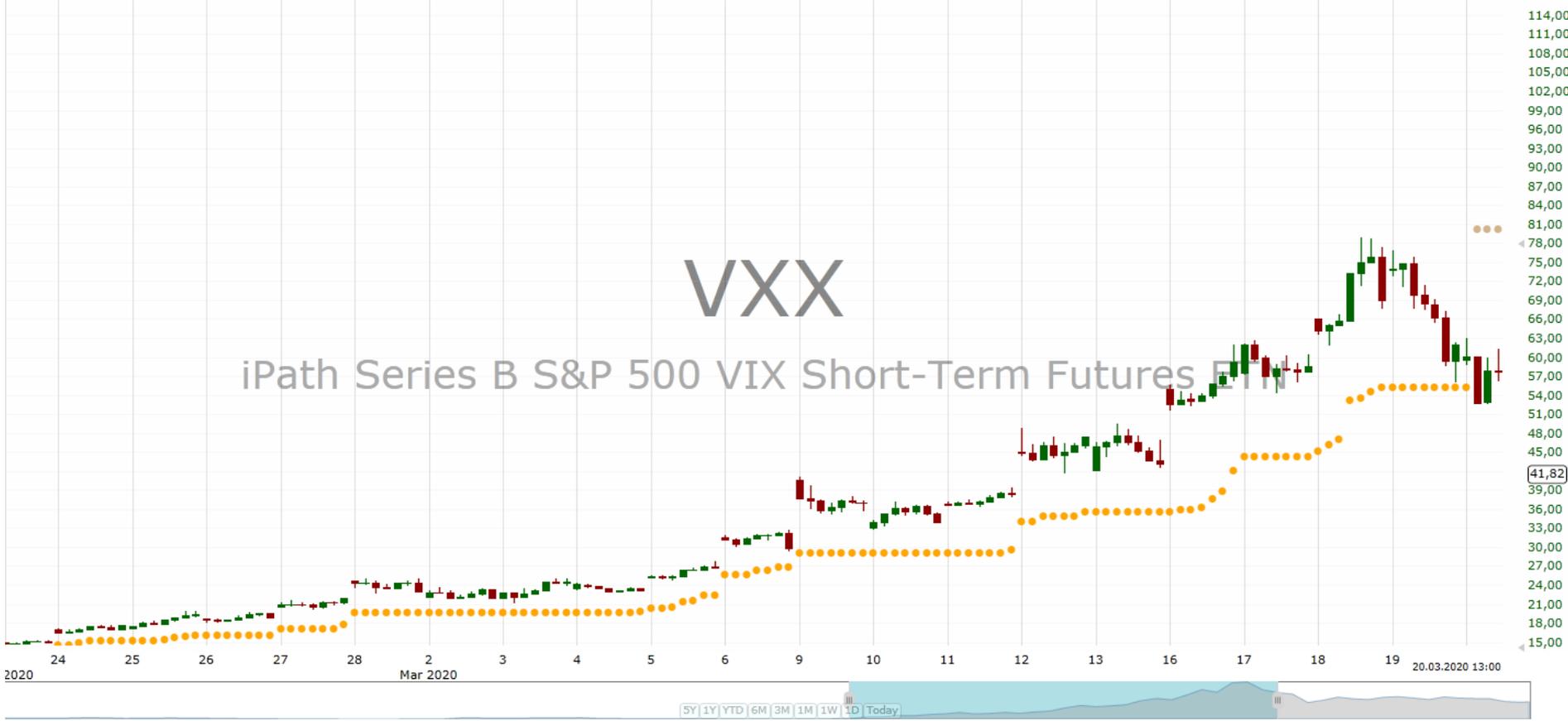
buy Hedges: 25.2.2020, 10 Marktmodelle: 40% => Ampel rot



Crash-Test Versuchsaufbau

sell Hedges: 20.3.2020, VXX Stundenchart Vola-Stop Exit

Price History ▾ Volatility Stop 20 5,00 ▾



Backtest mit der TOS

Hedge	Options	DTE	25.2.2020	20.3.2020	Faktor
Teeny	buy SPX April put 2000	51	208\$	5877\$	29
BSH (Ron B.)	buy SPX May put -1 2350 +2 2300	80	620\$	18448\$	30
BSH (Ron B.)	buy SPY May put -1 235 +2 230	80	43\$	1402\$	33
Vola-Bomb	buy VIX April call 40, delta 10	40	35\$	2365\$	68
Vola-Bomb	buy VXX April call 35, delta 10	35	34\$	2712\$	80
VXX Long	(Direkt Investment)		19\$	61\$	3
SPX Short	(Direkt Investment)		3128\$	2305\$	1

Ergebnisse

- BSH sehr Margin intensiv (Reg-T), daher nur bedingt geeignet
- am besten ist ein Mix aus Teenies und Vola-Bomben
- diese Strategien sind einfach aufzusetzen
- erfüllen alle Anforderungen an einen Hedge und
- haben sich im Corona-Crash bewährt!

Danke für Eure Aufmerksamkeit !

hier mein Teeny beim Crash-Test:

