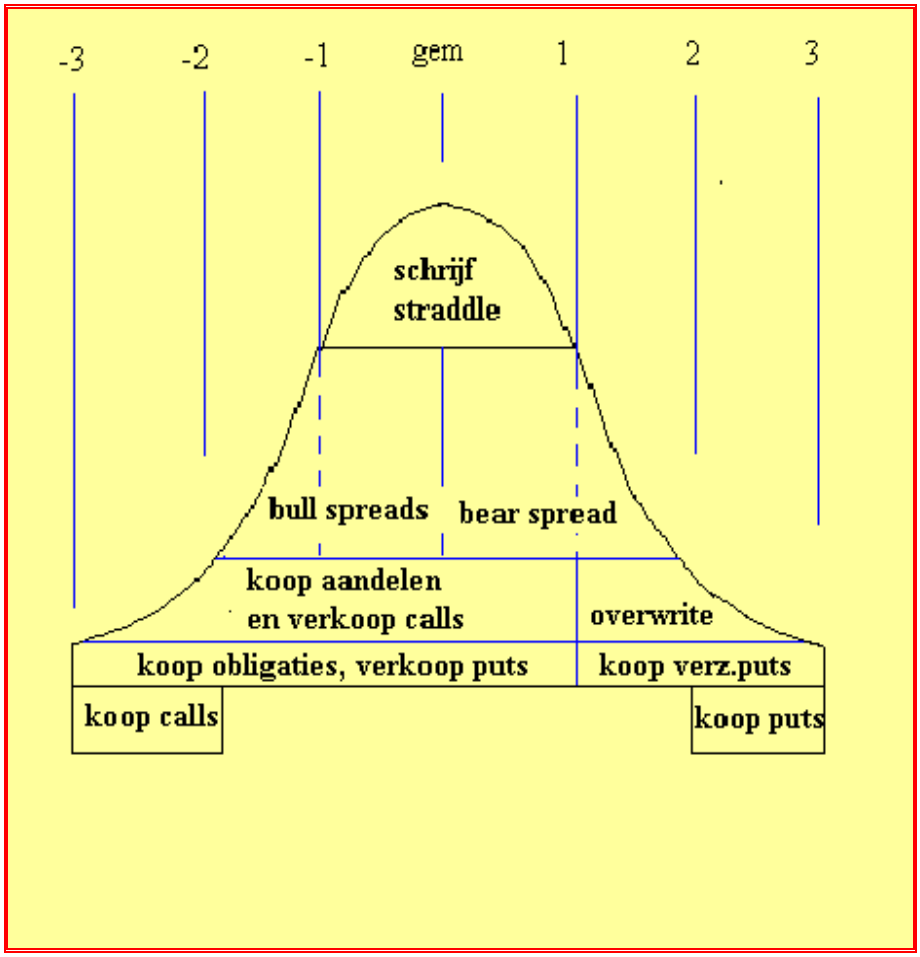


Option spectrum met standaarddeviaties

Bovenin de figuur vinden we het aantal standaardafwijkingen van het gemiddelde. Zouden we precies op het gemiddelde zitten, dan zitten we in het midden van de curve. Als gemiddelde wordt meestal het 90 daags voortschrijdend gemiddelde genomen.

We zien ook, dat de bij particulieren zo geliefde strategieën als Koop call en koop put slechts in uitzonderingssituaties aan de orde komen.

We zullen de strategieën stuk voor stuk nog even bekijken. We zien in onderstaande figuur, dat de curve in drie delen valt te verdelen, die overeenkomen met de standaardafwijkingen. Een haussedeel (koers zal waarschijnlijk omhoog gaan), een neutraal deel (koers zal ongeveer gelijk blijven) en een baisse deel (koers zal waarschijnlijk omlaag gaan. We zien, dat 66% van de curve in het neutrale deel valt. De strategie die hierin valt heeft dus veel kans van slagen. Valt hij ook