



Prensa

Noticias del mundo de los Derivados

Artículo Ratio writing: una estrategia con opciones de alta volatilidad Cuando la volatilidad implícita de las opciones es alta, las estrategias de venta deberían sustituir a las de compra debido a que estas últimas se vuelven muy onerosas. El ratio writing, es decir, la venta de más opciones de las que se compran es una de esas estrategias, una que será rentable a partir de la reversión a la media de la volatilidad implícita. Sin embargo, el riesgo de pérdidas en la negociación con commodities puede ser sustancial. Los inversores deberían por tanto considerar cuidadosamente si tales estrategias le resultan convenientes. El presente artículo discute como identificar las condiciones apropiadas para este tipo de operatoria y como fijar esta clase de negocios para una alta probabilidad de éxito.

Noticias

Avanza la fusión de Rofex y Mervaros (ON24 - 16/08/2010) USE lanza la negociación de futuros de divisas (The Hindu - 17/08/2010) Las opciones sobre KOSPI 200 serán negociadas en Eurex (Korea Times - 18/08/2010) Estados Unidos permite la negociación de futuros sobre índices accionarios turcos (Reuters - 18/08/2010) Cambia el BCRA el plan por la emisión de pesos (Ámbito Financiero - 18/18/2010) El SMX de Singapur se focaliza en contratos con entrega para ganar mercado (Reuters - 19/08/2010)

Libros Recomendados

Introduction to Derivatives and Risk Management, 8th Edition (Don M. Chance, Roberts Brooks) Day Trading Grain Futures (David Bennett)



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial


 twitter.com/bcypressa

 [es.linkedin.com/BCR](https://es.linkedin.com/company/BCR)

 www.instagram.com/BCR

 www.youtube.com/BolsadeRosario

 BOLSA DE COMERCIO DE ROSARIO
Córdoba 1402 - S2000AWV

 TELÉFONO
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL
contacto@bcr.com.ar

 WWW
bcr.com.ar