

Strategiekombinationen

Als integrierter Bestandteil der Handelsplattform unterstützt der Eurex Strategy WizardSM den Handel von Options- und Volatilitätsstrategien. Die folgenden 51 im System hinterlegten Strategien sind handelbar:

Optionsstrategien

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
STD	Straddle	2	Kauf Call, Kauf Put mit gleichem Basispreis ODAX STD FEB07 3900
STDT	Straddle Calendar Spread		Verkauf Call und Put mit kürzerer Laufzeit, Kauf Call und Put mit längerer Laufzeit (gleicher Basispreis für alle Optionen) ODAX STDT JAN07 FEB07 3900
DIASTD	Diagonal Straddle Calendar Spread		Verkauf Call und Put (Basispreis 1) mit kürzerer Laufzeit, Kauf Call und Put (Basispreis 2) mit längerer Laufzeit ODAX DIASTD JAN07 4000 FEB07 3900
STD-C	Straddle versus Call		Kauf Call, Kauf Put mit gleichem Basispreis, Verkauf Call mit anderem Basispreis ODAX STD FEB07 3800 versus C 3900
STD-P	Straddle versus Put		Kauf Call, Kauf Put mit gleichem Basispreis, Verkauf Put mit anderem Basispreis ODAX STD FEB07 3800 versus C 3900
STG	Strangle	2	Kauf Put, Kauf Call mit höherem Basispreis ODAX STG JAN07 3900 - 4000
BUL	Call Spread	0	Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis ODAX BUL JAN07 3900 - 4000
BUL-P	Call Spread versus Put		Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Put mit beliebigem Basispreis ODAX BUL FEB07 3900 - 4000 versus P 3800
BER	Put Spread	0	Kauf Put, Verkauf Put mit niedrigerem Basispreis ODAX BER JAN07 3900 - 3800
BER-C	Put Spread versus Call		Kauf Put, Verkauf Put mit niedrigerem Basispreis, Verkauf Call mit beliebigem Basispreis ODAX BER JAN07 4000 - 3900 versus C 3800

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
BLT	Call Calendar Spread		Verkauf Call mit kürzerer Laufzeit, Kauf Call mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit ODAX BLT JAN07 FEB07 3900
BRT	Put Calendar Spread		Verkauf Put mit kürzerer Laufzeit, Kauf Put mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit ODAX BRT JAN07 FEB07 3900
CDIA	Call Diagonal Calendar Spread		Verkauf Call mit kürzerer Laufzeit, Kauf Call mit anderem Basispreis und längerer Laufzeit ODAX CDIA JAN07 3900 FEB07 4000
PDIA	Put Diagonal Calendar Spread		Verkauf Put mit kürzerer Laufzeit, Kauf Put mit anderem Basispreis und längerer Laufzeit ODAX PDIA JAN07 4000 FEB07 3900
RBUL	2x1 Ratio Call Spread		Verkauf 1 Call, Kauf 2 Calls mit höherem Basispreis ODAX RBUL JAN07 3900 - 4000
RBER	2x1 Ratio Put Spread		Verkauf 1 Put, Kauf 2 Puts mit niedrigerem Basispreis ODAX RBER FEB07 3900 - 4000
CBUT	Call Butterfly	0	Kauf 1 Call, Verkauf 2 Calls mit höherem Basispreis, Kauf 1 Call mit höherem Basispreis (gleicher Abstand) ODAX CBUT JAN07 3800 - 3900 - 4000
PBUT	Put Butterfly	0	Kauf 1 Put, Verkauf 2 Puts mit höherem Basispreis, Kauf 1 Put mit höherem Basispreis (gleicher Abstand) ODAX PBUT FEB07 3800 - 3900 - 4000
IBUT	Iron Butterfly	0	Verkauf Put, Kauf Put und Call mit höherem Basispreis, Verkauf Call mit höherem Basispreis (gleicher Abstand) ODAX IBUT JAN07 3800 - 3900 - 4000
CLAD	Call Ladder		Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Call mit höherem Basispreis (gleicher Abstand) ODAX CLAD JAN07 3800 - 3900 - 4000
PLAD	Put Ladder		Verkauf Put, Verkauf Put mit höherem Basispreis, Verkauf Put mit höherem Basispreis (gleicher Abstand) ODAX PLAD JAN07 3800 - 3900 - 4000
CNV	Conversion/Reversal		Kauf Call, Verkauf Put mit gleichem Basispreis ODAX CNV JAN07 4000

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
COMBO	Combo		Verkauf Call, Kauf Put mit niedrigerem Basispreis ODAX COMBO FEB07 3900 - 3800
GUTS	Guts	2	Kauf Call, Kauf Put mit höherem Basispreis ODAX GUTS JAN07 3900 - 4000
BOX	Box	0	Kauf Call/Verkauf Put mit gleichem Basispreis, Kauf Put/Verkauf Call mit höherem Basispreis ODAX BOX FEB07 4000 - 4100
CCOND	Call Condor	0	Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Kauf Call mit höherem Basispreis (immer gleicher Abstand) ODAX CCOND JAN07 3800 - 3900 - 4000 - 4100
PCOND	Put Condor	0	Kauf Put, Verkauf Put mit höherem Basispreis, Verkauf Put mit höherem Basispreis, Kauf Put mit höherem Basispreis (immer gleicher Abstand) ODAX PCOND JAN07 3800 - 3900 - 4000 - 4100

Volatilitätsstrategien*

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
CALL-U	Call Volatility Trade	1	Kauf Call, Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 C JAN07 4000 versus 17 FDAX MAR07 @ 3853
PUT+U	Put Volatility Trade	1	Kauf Put, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 P JAN07 3900 versus 47 FDAX MAR07 @ 3945
STD+U	Straddle versus Long Underlying	2	Kauf Call, Kauf Put mit gleichem Basispreis, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 STD JAN07 3900 versus 11 FDAX MAR07 @ 3953
STD-U	Straddle versus Short Underlying	2	Kauf 1 Put, Kauf 1 Call mit höherem Basispreis, Kauf Basiswert ODAX STG JAN07 3900 - 4000 versus 9 FDAX MAR07 @ 3957

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
STG+U	Strangle versus Long Underlying	2	Kauf 1 Put, Kauf 1 Call mit höherem Basispreis, Kauf Basiswert ODAX STG JAN07 3900 - 4000 versus 9 FDAX MAR07 @ 3957
STG-U	Strangle versus Short Basiswert	2	Kauf 1 Put, Kauf 1 Call mit höherem Basispreis, Verkauf Basiswert ODAX STG JAN07 3900 - 4000 versus 7 FDAX MAR07 @ 3945
BUL-U	Call Spread versus Underlying	0	Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 BUL FEB07 3800 - 3900 versus 24 FDAX MAR07 @ 3857
BER+U	Put Spread versus Underlying	0	Kauf Put, Verkauf Put mit niedrigerem Basispreis, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 BER JAN07 4000 - 3900 versus 22 FDAX MAR07 @ 4086
BUL-P-U	Call Spread versus Short Put/ Short Underlying		Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Put mit beliebigem Basispreis, Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 BUL JAN07 3900 - 4000 versus 100 P JAN07 4100 versus 54 FDAX MAR07 @ 4029
BER-C+U	Put Spread versus Short Call/ Long Underlying		Kauf Put, Verkauf Put mit niedrigerem Basispreis, Verkauf Call mit beliebigem Basispreis, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 BER JAN07 4000 - 3900 versus 100 P JAN07 4100 versus 54 FDAX MAR07 @ 3978
BLT+U	Call Calendar Spread versus Long Underlying	2	Verkauf 1 Call mit kürzerer Laufzeit, Kauf 1 Call mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit, Kauf Basiswert ODAX 100 STD JAN07 3900 versus 11 FDAX MAR07 @ 3953

* Anzahl der Optionen = 100 (oder ein Vielfaches davon). Für Strategien auf Basis des ODAX ist die Anzahl der Optionen auf 250 (oder ein Vielfaches davon) festgelegt. Bei Aktienoptionen orientiert sich die Anzahl der Optionen an der Kontraktsspezifikation des jeweiligen Produkts; bei Optionen auf Fixed Income Futures bezieht sich jede Volatilitätsstrategie auf 100 Optionen. Die Anzahl der Futures kann bei Definition der Strategie zwischen 1 und 100 festgelegt werden.

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
BLT-U	Call Calendar Spread versus Short Underlying	2	Verkauf 1 Call mit kürzerer Laufzeit, Kauf 1 Call mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit, Verkauf Basiswert ODAX 100 BER JAN07 4000 - 3900 versus 12 FDAX MAR07 @ 4086
BRT+U	Put Calendar Spread versus Long Underlying		Verkauf 1 Put mit kürzerer Laufzeit, Kauf 1 Put mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit, Kauf Basiswert ODAX 100 BRT JAN07 - FEB07 3900 versus 25 FDAX MAR07 @ 3937
BRT-U	Put Calendar Spread versus Short Underlying		Verkauf 1 Put mit kürzerer Laufzeit, Kauf 1 Put mit gleichem Basispreis und längerer Laufzeit, Verkauf Basiswert ODAX 100 BRT JAN07 - FEB07 3900 versus 25 FDAX MAR07 @ 3937
CLAD+U	Call Ladder versus Long Underlying		Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Call mit höherem Basispreis (gleicher Abstand), Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 CLAD FEB07 3800 - 3900 - 4000 versus 19 FDAX MAR07 @ 3855
CLAD-U	Call Ladder versus Short Underlying		Kauf Call, Verkauf Call mit höherem Basispreis, Verkauf Call mit höherem Basispreis (gleicher Abstand), Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 CLAD FEB07 3800 - 3900 - 4000 versus 11 FDAX MAR07 @ 3965
PLAD+U	Put Ladder versus Long Underlying		Verkauf Put, Verkauf Put mit höherem Basispreis, Kauf Put mit höherem Basispreis (gleicher Abstand), Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 PLAD FEB07 3800 - 3900 - 4000 versus 50 FDAX MAR07 @ 3850
PLAD-U	Put Ladder versus Short Underlying		Verkauf Put, Verkauf Put mit höherem Basispreis, Kauf Put mit höherem Basispreis (gleicher Abstand), Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 PLAD FEB07 3800 - 3900 - 4000 versus 35 FDAX MAR07 @ 3947

Strategie-kürzel	Strategie-bezeichnung	Mindestpreis (Anzahl Ticks)	Struktur der Strategie (aus Käufersicht)
COMBO+U	Combo versus Long Underlying		Verkauf Call, Kauf Put mit niedrigerem Basispreis, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 COMBO JAN07 3900 - 3800 versus 80 FDAX MAR07 @ 3871
RBUL+U	2x1 Ratio Call Spread versus Long Underlying		Verkauf 1 Call, Kauf 2 Calls mit höherem Basispreis, Kauf Basiswert ODAX RBUL JAN07 3900 - 4000 versus 17 FDAX MAR07 @ 3853
RBUL-U	2x1 Ratio Call Spread versus Short Underlying		Verkauf 1 Call, Kauf 2 Calls mit höherem Basispreis, Verkauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 / 200 RBUL JAN07 3800 - 3900 versus 1 FDAX MAR07 @ 3867
RBER+U	2x1 Ratio Put Spread versus Long Underlying		Verkauf 1 Put, Kauf 2 Puts mit niedrigerem Basispreis, Kauf Basiswert (insgesamt deltaneutral) ODAX 100 / 200 RBER JAN07 3900 - 3800 versus 5 FDAX MAR07 @ 3898
RBER-U	2x1 Ratio Put Spread versus Short Underlying		Verkauf 1 Put, Kauf 2 Puts mit niedrigerem Basispreis, Verkauf Basiswert ODAX RBER FEB07 3900 - 4000 versus 13 FDAX MAR07 @ 3953
CNV-U	Conversion versus Underlying		Kauf 1 Call, Verkauf 1 Put mit gleichem Basispreis, Verkauf Basiswert ODAX CNV JAN07 3900 versus 19 FDAX MAR07 @ 4153