

Atene 18 Ottobre 2018

Buongiorno a tutti, vi voglio segnalare uno spread che mi ha dato delle soddisfazioni negli ultimi 10 gg .(su 3 trades sono andati tutti a segno).

Penso che la vera ragione è la stagionalità.

Ho cercato di replicarlo su Season Algo lo stesso spread ma mi da risultati diversi.

Lo spread margina 1.850 \$ circa e ha un rendimento di circa 25 % (la mia strategia di gain per ogni trade)nei tre giorni dall'apertura.(circa 500 \$ di gain).

Prima di dirvi qual' è lo spread, voglio raccontarvi e discutere i miei ragionamenti .

1)Nel settore energetico, il periodo invernale è particolarmente in fermento, specialmente se ci sono degli eventi climatici straordinari ,uragani , nevicata, piogge ,freddo polare, etc etc etc.

2) Ci sono dei mercati che non possono seguire la logica della domanda e offerta ma che dipendono dalle decisioni politiche.

Penso che avete capito che lo spread in questione è il gasolio da riscaldamento HO e la benzina (Gasoline )RB.

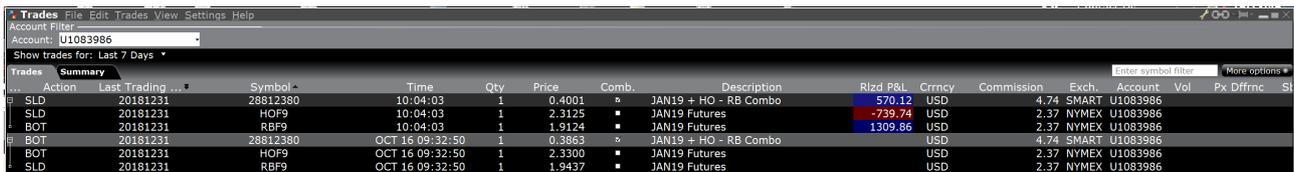
Come voi sapete a mettere sul mercato uno spread Intermarket (due mercati differenti) si acquista quello più forte e si vende quello più debole.

Nel nostro caso il Gasolio ,che ha una domanda forte in questo periodo va comprato e venduto il mercato Gasoline RB ,che per questioni anche politiche il suo prezzo non può essere libero di fluttuare.

Ma questo ,**RIPETO** è una forte stagionalità che dura pochi gg (max 30-40) a partire da 10 Ottobre.

Le scadenze dello spread sono Dicembre, Gennaio e al massimo Febbraio.

Qui si seguito vi allego l'ultimo trade .



Action	Last Trading	Symbol	Time	Qty	Price	Comb.	Description	Rlzd P&L	Crrncy	Commission	Exch.	Account	Vol	Px Dffnc	Sl
SLD	20181231	28812380	10:04:03	1	0.4001	*	JAN19 + HO - RB Combo	570.12	USD	4.74	SMART	U1083986			
SLD	20181231	HOF9	10:04:03	1	2.3125	*	JAN19 Futures	-739.74	USD	2.37	NYMEX	U1083986			
BOT	20181231	RBF9	10:04:03	1	1.9124	*	JAN19 Futures	1309.86	USD	2.37	NYMEX	U1083986			
BOT	20181231	28812380	OCT 16 09:32:50	1	0.3863	*	JAN19 + HO - RB Combo		USD	4.74	SMART	U1083986			
BOT	20181231	HOF9	OCT 16 09:32:50	1	2.3300	*	JAN19 Futures		USD	2.37	NYMEX	U1083986			
SLD	20181231	RBF9	OCT 16 09:32:50	1	1.9437	*	JAN19 Futures		USD	2.37	NYMEX	U1083986			

Certo di ricevere un vostro commento in merito

Saluti

Angelo