

Atene 19-Oct-2018

Su quale contratto conviene entrare ?

Ecco come si sceglie la scadenza.

Si nota la % di Change dei due contratti e si sceglie quello con la maggiore differenza.

in questo caso i contratti di Gennaio segnano una differenza di 0.09 % (0.20- 0.11).

Notare solo per il ragionamento che lo spread di febbraio è più conveniente di farlo con il segno opposto . cioè vendere HO e comprare RB.

Select Account	U1083986	Notes	Tckr Actn	Volume	FUT OpenInt	Vega	Delta	Last	Change	Change %	Bd Sz	Bid	Ask	Ask Sz
Financial Instrument	Key		Account			Lmt Px	Cncl	Status	Transmit	Quantity	Type		TIF	
HO INDEX														
HO Nov'18 @NYMEX				437	72.7K			2.3015	+0.0066	0.29%	2	2.3010	2.3015	2
HO Mar'19 @NYMEX				67	45.1K			2.2966	+0.0066	0.29%	1	2.2950	2.2961	1
HO May'19 @NYMEX				14	10.0K			c2.2737			2	2.2780	2.2800	1
HO Jun'19 @NYMEX				22	26.1K			2.2730	+0.0027	0.12%	1	2.2745	2.2764	1
HO Jul'19 @NYMEX				1	6.38K			c2.2739			1	2.2777	2.2799	1
RB INDEX														
RB Nov'18 @NYMEX				321	67.5K			1.8923	+0.0012	0.06%	1	1.8946	1.8953	2
RB Mar'19 @NYMEX				3	34.6K			1.9363	+0.0056	0.29%	1	1.9329	1.9344	2
RB May'19 @NYMEX				3	18.3K			c2.1276			2	2.1294	2.1319	1
HO, RB Apr'19 + RB - HO				1				-0.1655	-0.0048	-1.99%	1	-0.1644	-0.1609	2
RB Apr'19 @NYMEX				1	19.2K			c2.1188			1	2.1211	2.1232	2
HO Apr'19 @NYMEX				27	25.2K			2.2864	+0.0069	0.30%	3	2.2841	2.2855	1
HO, RB Dec - HO + RB				8				-0.4131	-0.0047	-1.15%	1	-0.4110	-0.4099	1
HO, RB Jan'19 + HO + RB											1	4.2001	4.2015	1
RB Dec'18/Apr'19 Calendar NYMEX				1				0.2309	+0.0001	0.04%	1	0.2287	0.2312	12
Trades Vincenti: Si vende il più forte e si vende il più de...														
HO, RB Dec + HO - RB	Bought @ 0.4041	18/Oct/18		8				0.4131	+0.0047	1.15%	1	0.4099	0.4110	1
HO Dec'18 @NYMEX				424	115K			2.3011	+0.0047	0.20%	3	2.3023	2.3029	2
RB Dec'18 @NYMEX				900	122K			1.8924	+0.0044	0.23%	1	1.8919	1.8924	1
HO, RB Jan'19 + HO - RB	Bought @ 0.4002	18/Oct/18		1				0.4073	+0.0020	0.49%	1	0.4066	0.4080	1
HO Jan'19 @NYMEX				87	76.5K			2.3026	+0.0046	0.20%	3	2.3037	2.3044	2
RB Jan'19 @NYMEX				50	75.2K			1.8948	+0.0021	0.11%	1	1.8964	1.8971	1
HO, RB Feb'19 - RB + HO	Bought @ 0.3877	18/Oct/18		1				0.3943	+0.0051	1.31%	1	0.3904	0.3925	2
HO Feb'19 @NYMEX				85	30.8K			2.2971	+0.0015	0.07%	1	2.3010	2.3018	2
RB Feb'19 @NYMEX				3	22.2K			1.9126	+0.0062	0.33%	2	1.9093	1.9106	2

Vediamo altre informazioni

Notare la posizione dei COT i commercials non sono interessati al mercato e l'accumulazione è ai massimi con tendenza a diminuire, questo giustifica i contratti di Febbraio



