

## Торговля опционами Московской биржи и волатильностью ликвидных фьючерсов.

15.1.2018	Intraday	Position	Option	Risk	Exp. date
RI	BFO	BFO	buy	ReHedge	18.01.2018
					15.03.2018
Si			buy	ReHedge	18.01.2018
			sell	Delta Hedge/Roll	15.03.2018
MXI		BFO			18.01.2017
Brent	BFO	BFO			26.01.2017
SBER	BFO				17.01.2017
GAZP	BFO				17.01.2017

BFO – алго робот покупки волатильности, SFO – алго робот продажи волатильности

Опционы – рыночно нейтральные стратегии покупки (buy) или продажи (sell) опционов около денег (ATM).

Рекомендация без цвета означает ближе к нейтральной позиции, слабая рекомендация.

[Раздел частых вопросов по Option-lab](#)

[Telegram канал Option-lab](#)