

Informationsbroschüre

Alle wichtigen Informationen zur
MH Diversified-Hedging-Strategie im Kurzüberblick.

2019

OPTIONS  CONSULTING

DIE MH

DIVERSIFIED-HEDGING-

STRATEGIE

Funktioniert mit transparent gepreisten,
hochliquiden und börsengehandelten
Optionskontrakten



Steht Ihnen für Ihre zusätzliche
Alpha-Quelle als separate Einzelstrategie
und als Kombination in Ihrem Portfolio-
management zur Verfügung



Verfolgt kein kurzfristig ausgelegtes
Trading und vermeidet häufige
Transaktionsanpassungen



Nutzt systematisch auftretende
Bewertungsdifferenzen an den
Optionsmärkten aus und basiert auf
einem striktem Regelwerk



Entfaltet ihr Hauptpotential bei
stagnierenden und fallenden
Aktienmärkten



BIETET IHNEN DIE FOLGENDEN **POSITIVEN EIGENSCHAFTEN**

Nachteile im Portfoliohedging mit der **Long-Put-Position**

- ➖ Hohe Hedgingkosten
- ➖ Funktioniert nur effektiv innerhalb stark korrigierendem Marktumfeld
- ➖ Wenig individueller Gestaltungsspielraum bei sich ändernder Marktbeurteilung

Ihr Portfoliohedging mit der **MH-DIVERSIFIED-HEDGING-STRATEGIE**

- ➕ Effizientes Hedging durch innovative Strategieentwicklung
- ➕ Bietet Ihnen Renditepotential bei stagnierenden und bei fallenden Aktienmärkten
- ➕ Sie können Ihre Positionen basierend auf ihrer individuellen Marktprognose in zahlreichen Variationen steuern



Air





UNTERLIEGT KONSEQUENTEM RISIKOMANAGEMENT

VaR				
2014	2015	2016	2017	2018
1,05%	0,89%	0,82%	0,53%	1,13%

- 1 Das Basiskonzept dieser erfolgreichen Strategie bietet Ihnen genügend Spielraum beim Anpassen der einzelnen Positionen. Es handelt sich um ein in sich geschlossenes Handelssystem ohne den berühmten „Fall ins Bodenlose“.
- 2 Durch das gleichzeitige Vereinnahmen von Zeitwertprämien sinken Ihre Absicherungskosten im Vergleich zu einem einfachen „Long Put“ signifikant.
- 3 Sie halten keine ungesicherten Shortpositionen während der gesamten Strategielaufzeit.

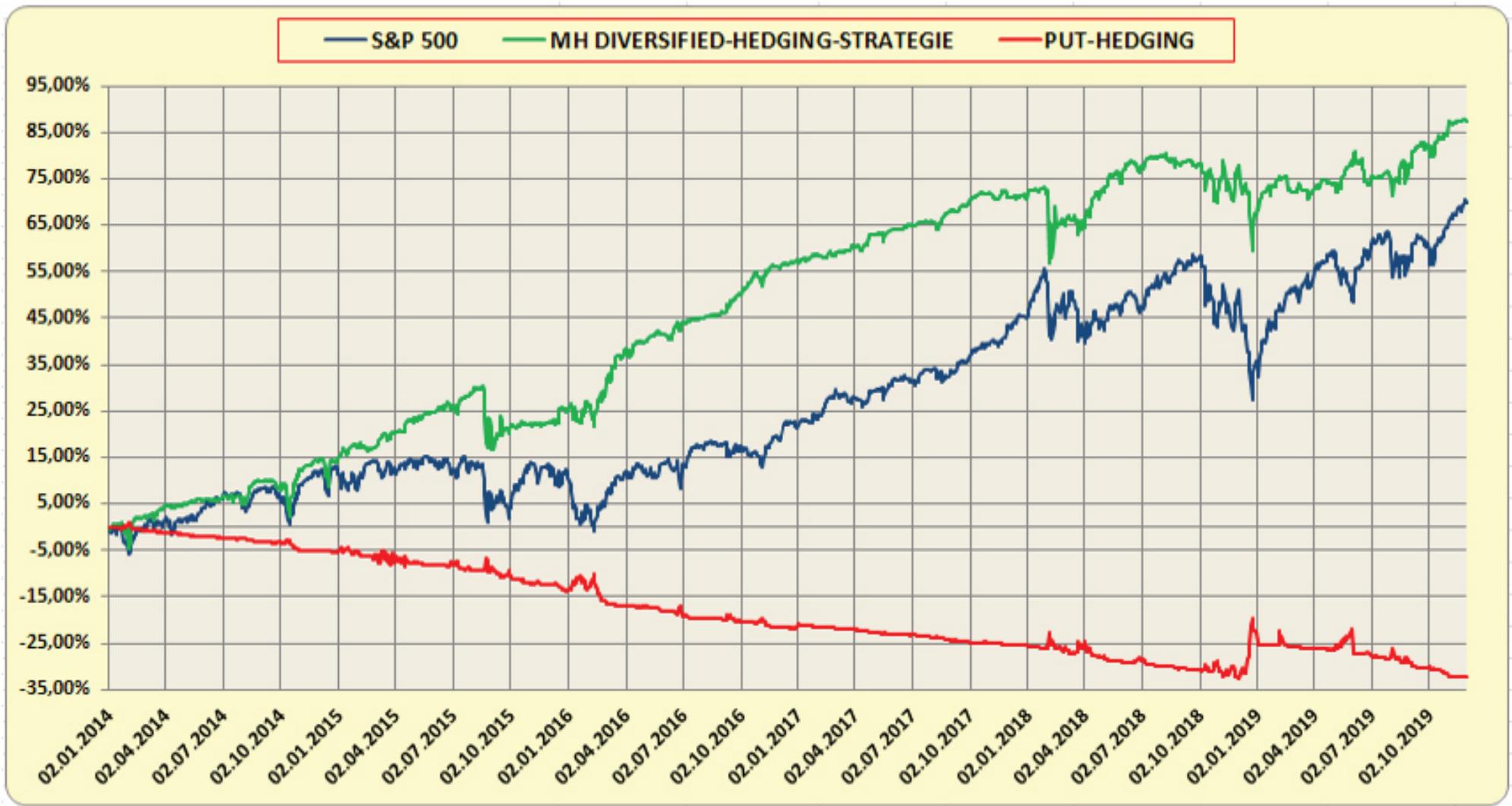
ERZIELTE AUF TAGESBASIERTEN HISTORISCHEN OPTIONS DATEN DIE FOLGENDE **PERFORMANCE AB DEM 01.01.2014**

Diagramm 1 zeigt Ihnen

- a** Eine Investition in den zugrundeliegenden Aktienindex

- b** Eine Investition in den zugrundeliegenden Aktienindex in Kombination mit einer Absicherung über den Kauf von Verkaufsoptionen (Long Puts)

- c** Eine Investition in den zugrundeliegenden Aktienindex in Kombination mit einer Investition in die **MH DIVERSIFIED-HEDGING-STRATEGIE**

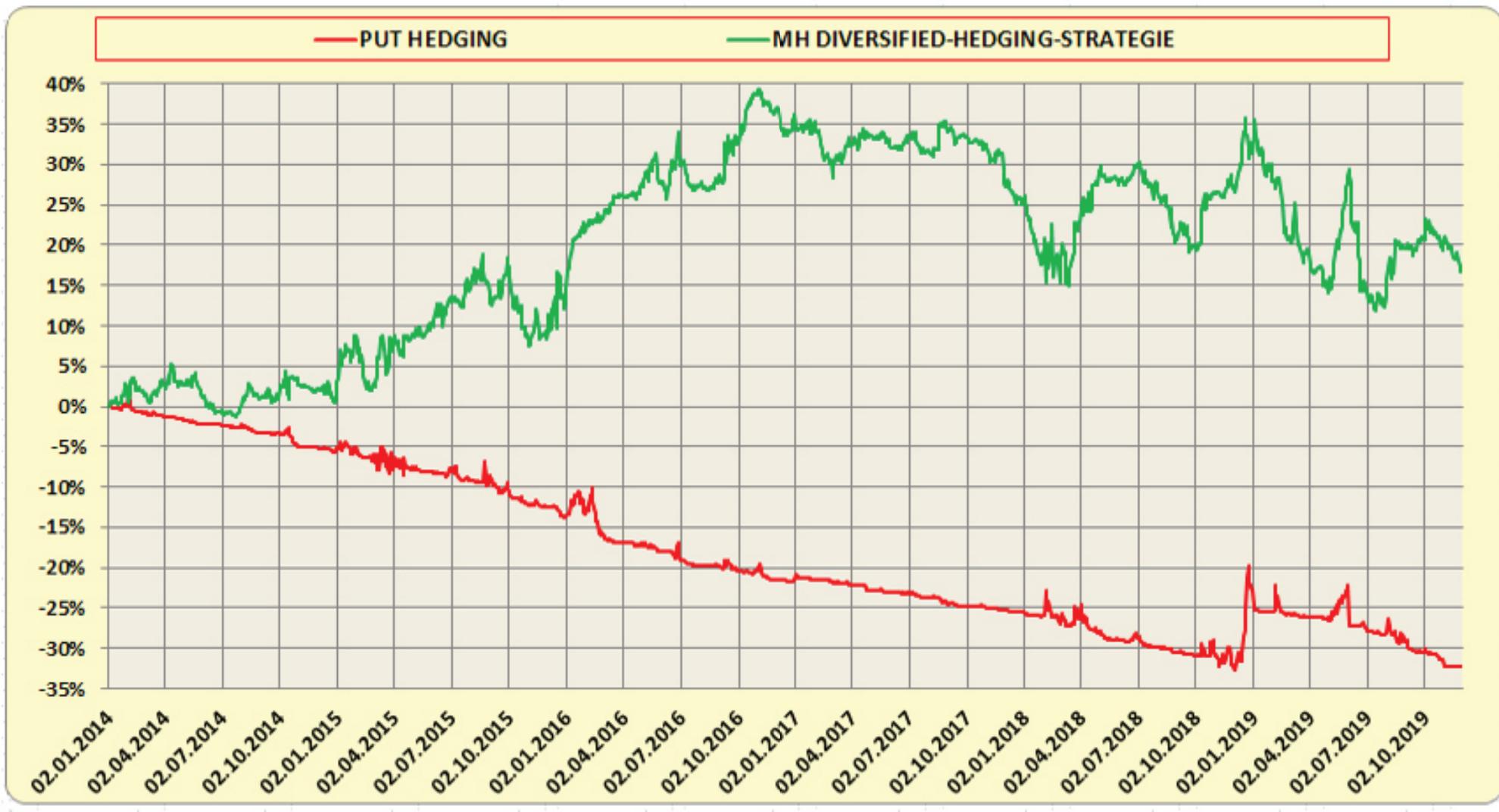


ERZIELTE AUF TAGESBASIERTEN HISTORISCHEN OPTIONS DATEN DIE FOLGENDE **PERFORMANCE AB DEM 01.01.2014**

Diagramm 2 zeigt Ihnen

- a** Die Rendite der Absicherung über den Kauf von Verkaufsoptionen (Long Puts)

- b** Die Rendite der **MH DIVERSIFIED-HEDGING-STRATEGIE**



MARCO HASSLER

- Über zehn Jahre Erfahrung bei Finanzinstituten mit Schwerpunkt Wertpapiere und Derivate
- Bankbetriebswirt
- Händlerzulassungen
 - Eurex*
 - Xetra*
 - NASD-Series 3 - Commodity Exam*
 - ACI - Dealing - Certificate*





SIE MÖCHTEN DIESE STRATEGIE
IN IHR PORTFOLIOMANAGEMENT INTEGRIEREN?

DANN SPRECHEN SIE MICH AN.

Mobil **+49 170 757 64 35** Mail **marco.hassler@options-consulting.de**

RISIKOHINWEIS

Investitionen in Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente sind mit Risiken verbunden und können neben den Erträgen auch zu erheblichen Verlusten des eingesetzten Kapitals führen. Wenn das Wertpapier in einer anderen Währung als Euro erworben wird, können zusätzlich noch Wechselkursrisiken für den Anleger entstehen. Die angebotenen Dienstleistungen stellen keine Anlageberatung dar.

Wir möchten daher darauf verweisen, vor dem Kauf von Wertpapieren mit ihrer Bank oder Ihrem Finanzberater zu sprechen. Die Inhalte wurden sorgfältig nach bestem Wissen und Gewissen erstellt. Eine Gewähr für die Richtigkeit der Informationen, als auch für die Vollständigkeit der hier gemachten Angaben können wir jedoch nicht übernehmen. Erzielte Gewinne in der Vergangenheit stellen keine Garantie für zukünftige Gewinne dar.