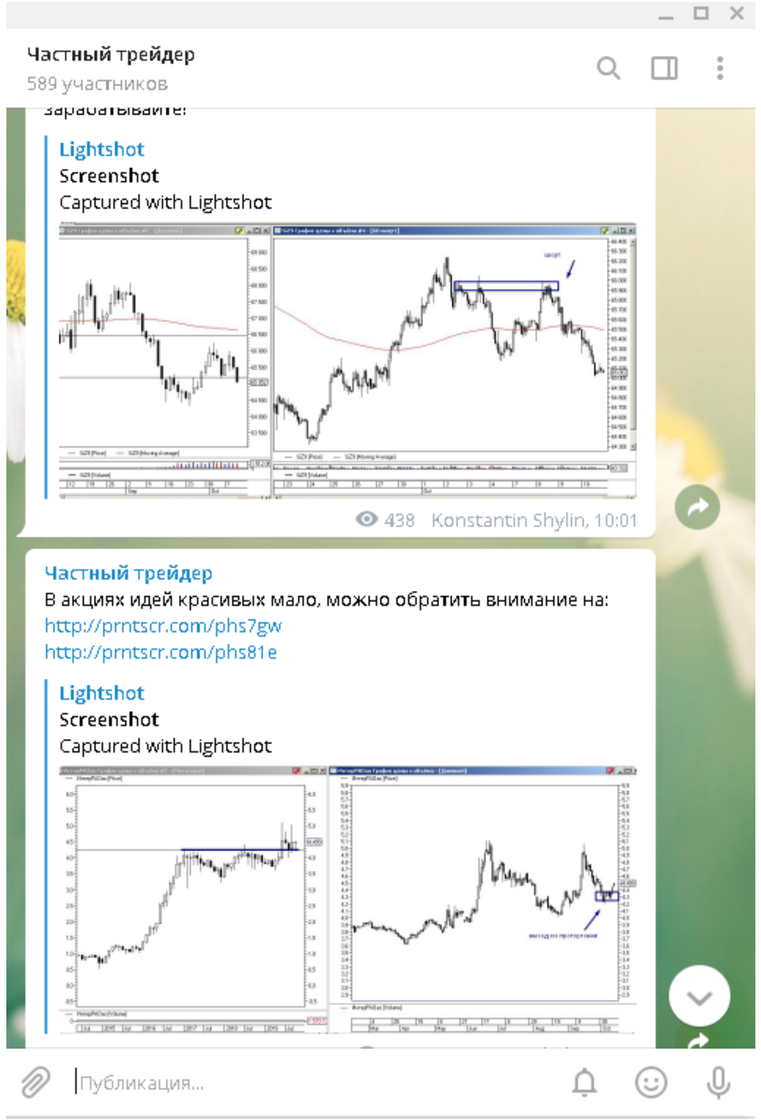
ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
от новичка до профи

Еженедельная встреча трейдеров

Опционы для нематематиков

© shilintrade.com



Частный трейдер

@private_trading

© shilintrade.com

Сегодня в программе:

- что такое опцион, простыми словами

- как их применить

- как торговать без стопов

- почему купил опцион и не заработал при движении фьючерса

- когда прогнозируемая прибыль превращается в неконтролируемый убыток

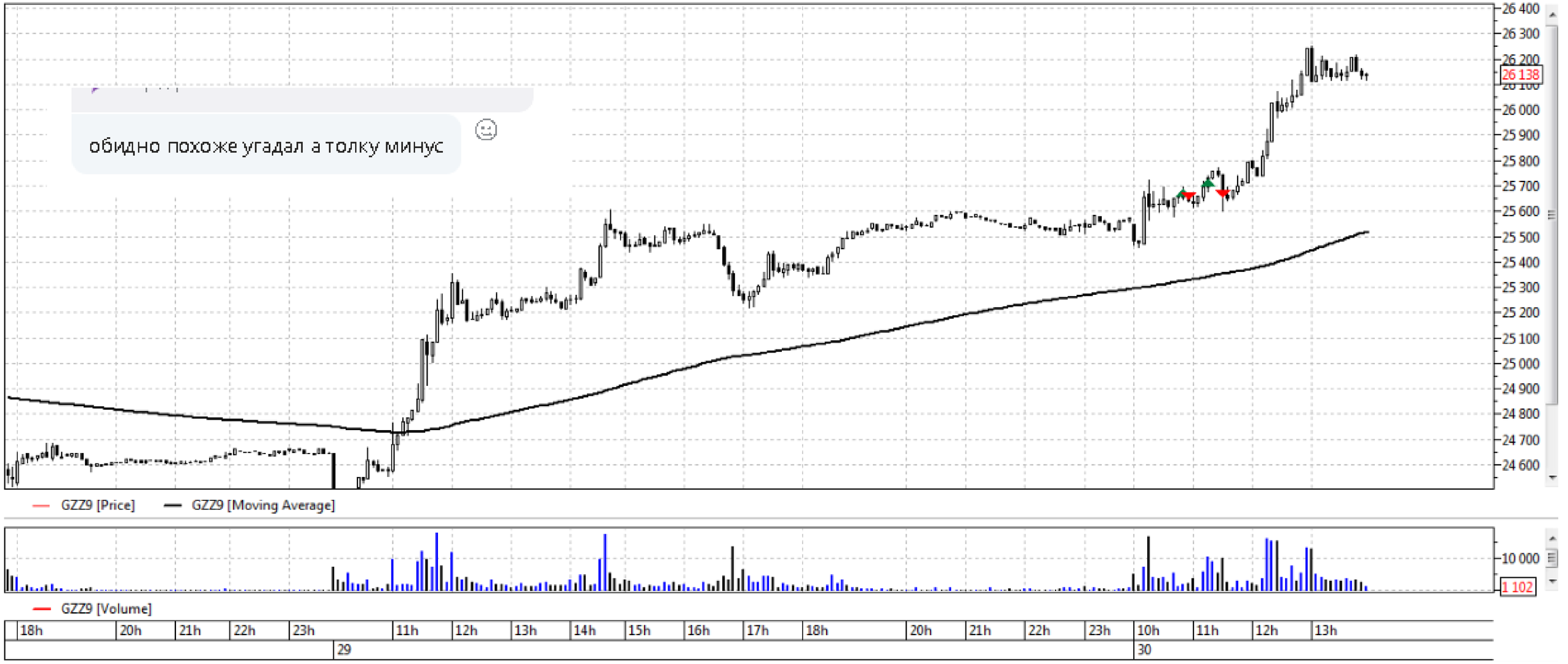
- риски в работе с опционами

- при каких стратегиях опасны резкие движения, гепы
  (случай с Ильей Коровиным, когда в апреле 2018 он потерял все)

- можно ли опционами хеджировать позицию в акциях

© shilintrade.com

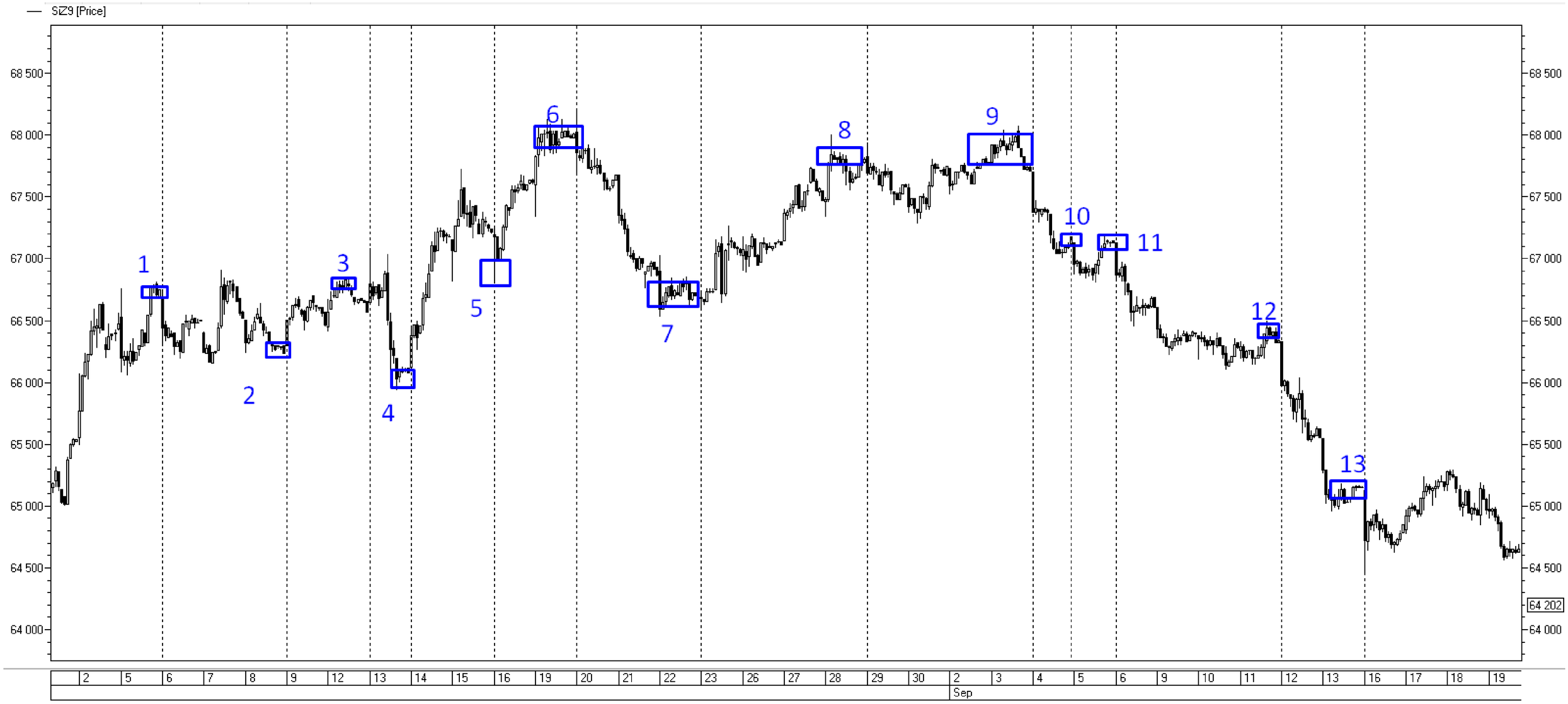
.. угадал все буквы..



.. купил дно – второе в подарок..

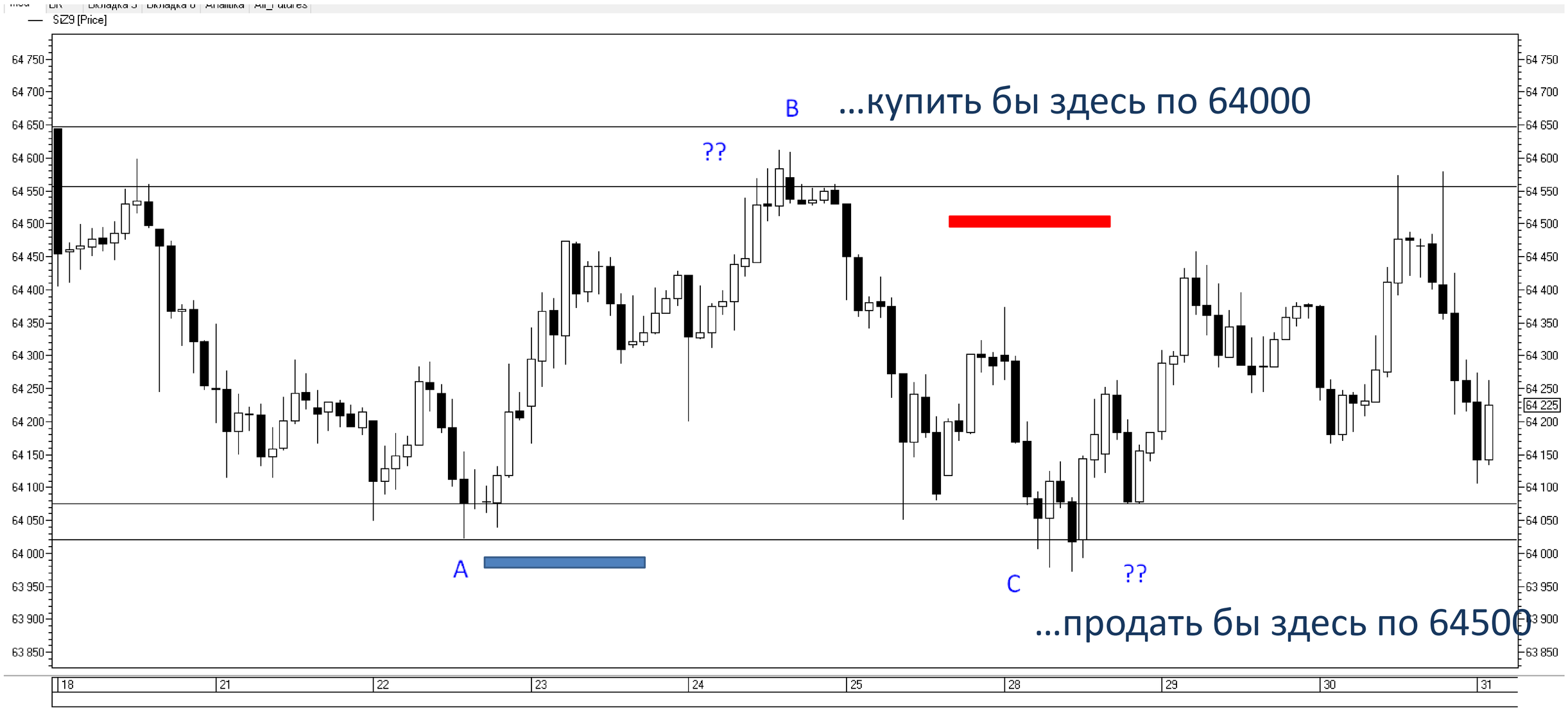
© shilintrade.com

сигналы ночью



© shilintrade.com

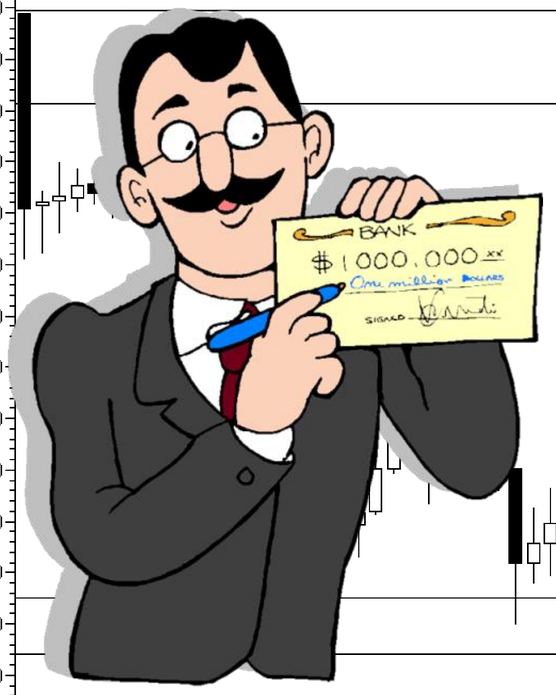
знал бы прикуп ;)



право купить/продать

знал бы прикуп ;)

SiZ9 [Price]



продавец

B ...купить бы здесь по 64000

??

200 руб

A

300 руб

C ??

...продать бы здесь по 64500

64 750 64 700 64 650 64 600 64 550 64 500 64 450 64 400 64 350 64 300 64 250 64 225 64 200 64 150 64 100 64 050 64 000 63 950 63 900 63 850

18 21 22 23 24 25 28 29 30 31

ГО Si 4300 руб

© shilintrade.com

ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
от новичка до профи

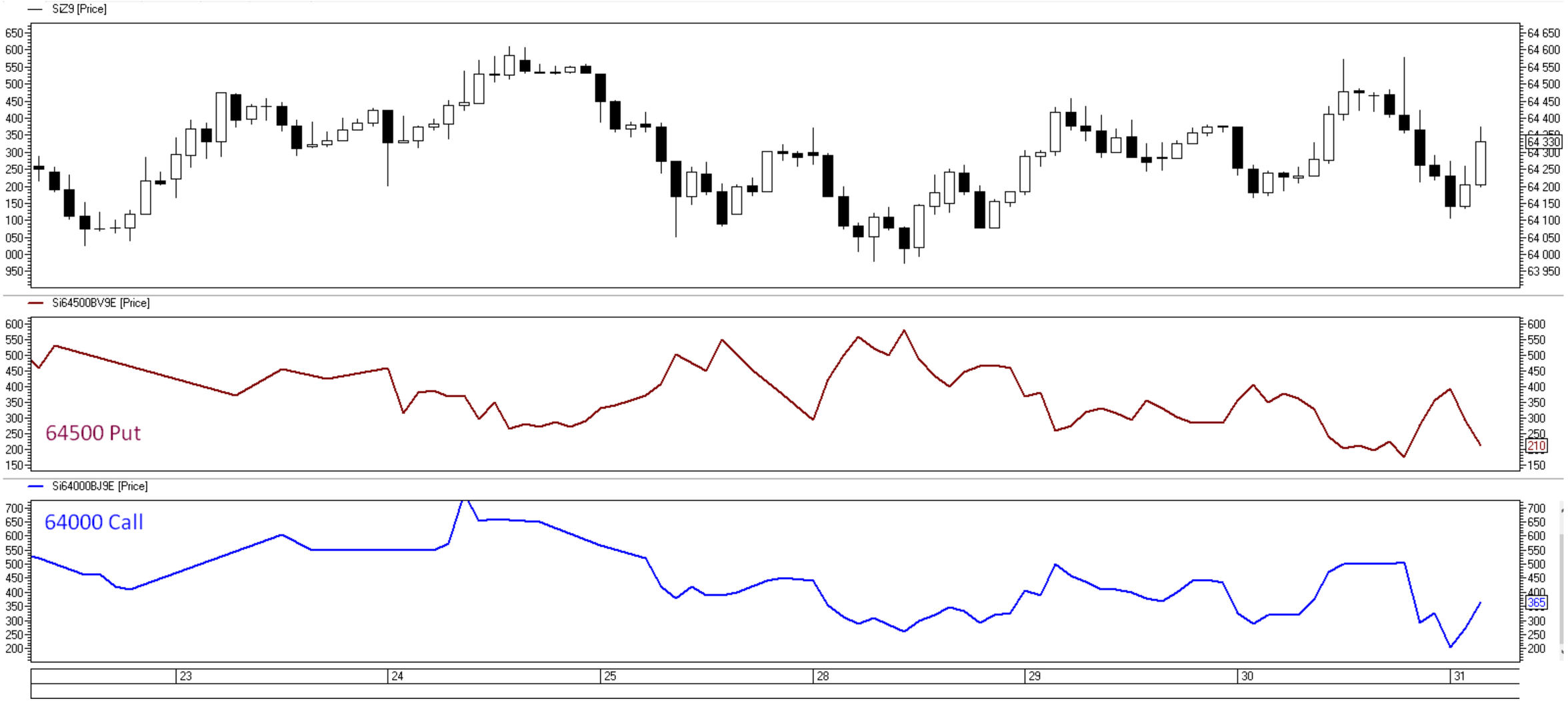
опцион
право купить/продать

знал бы прикуп ;)

ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
от новичка до профи

опцион
право купить/продать

что будет с премией?


SiZ9 [Price]
Si64500BV9E [Price]
64500 Put
Si64000BJ9E [Price]
64000 Call
23
24
25
28
29
30
31

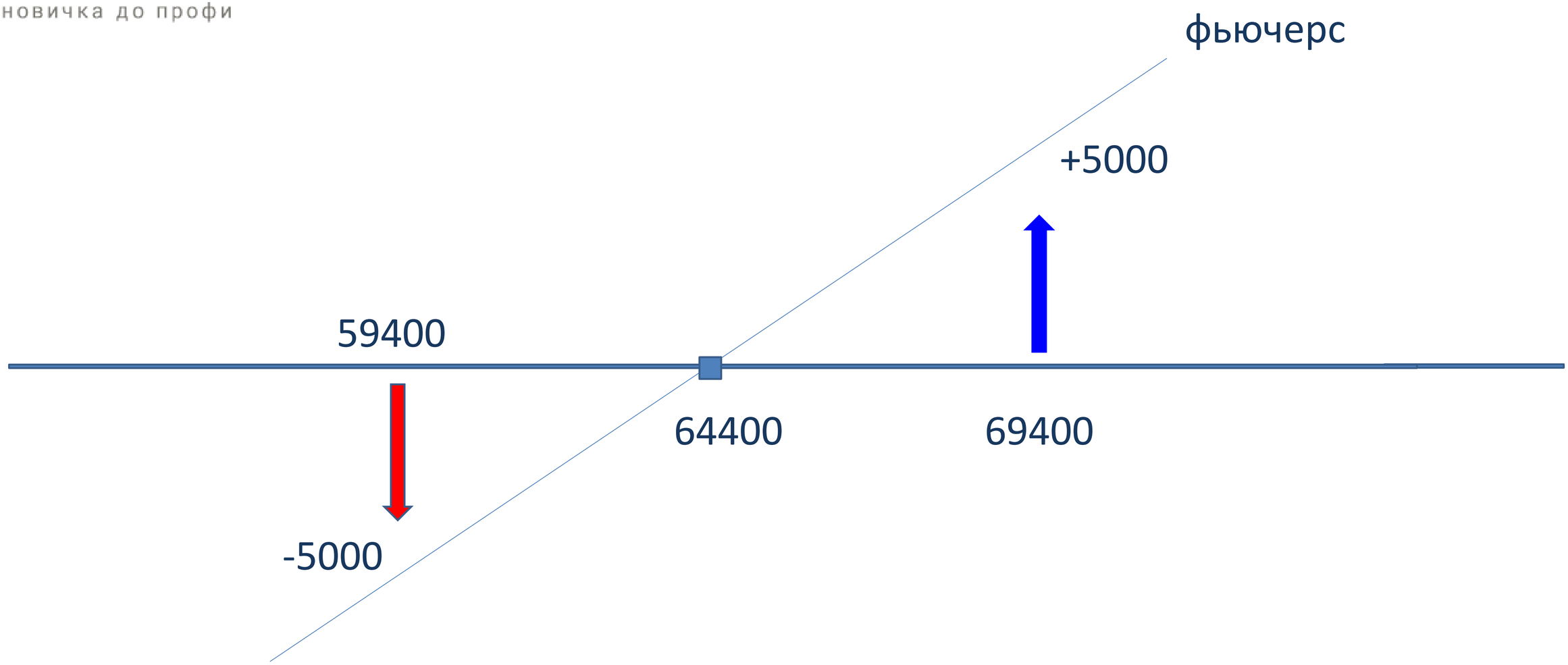
опцион
право купить/продать

что будет с премией?

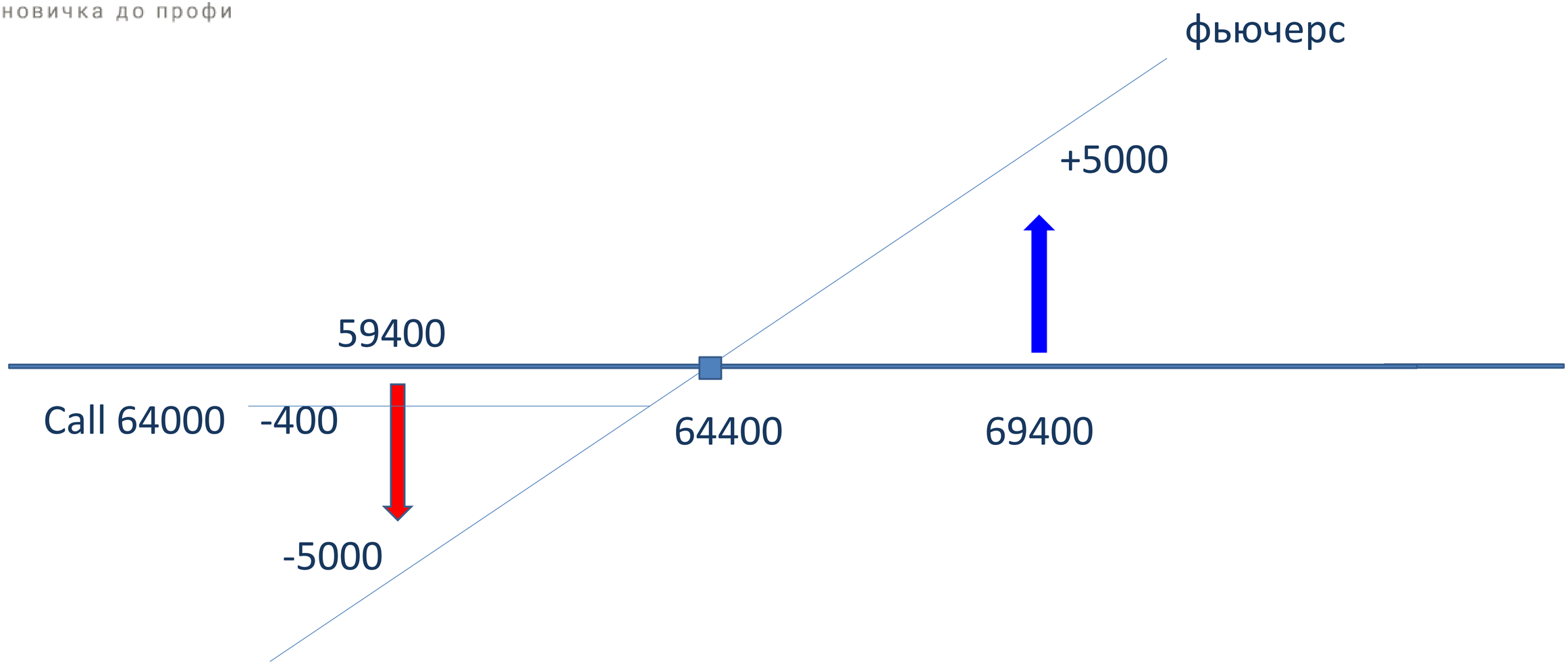
+5000

SiZ9 [Price]
Si64500BV9E [Price]
64500 Put
Si64000BJ9E [Price]
64000 Call
23
24
25
28
29
30
31

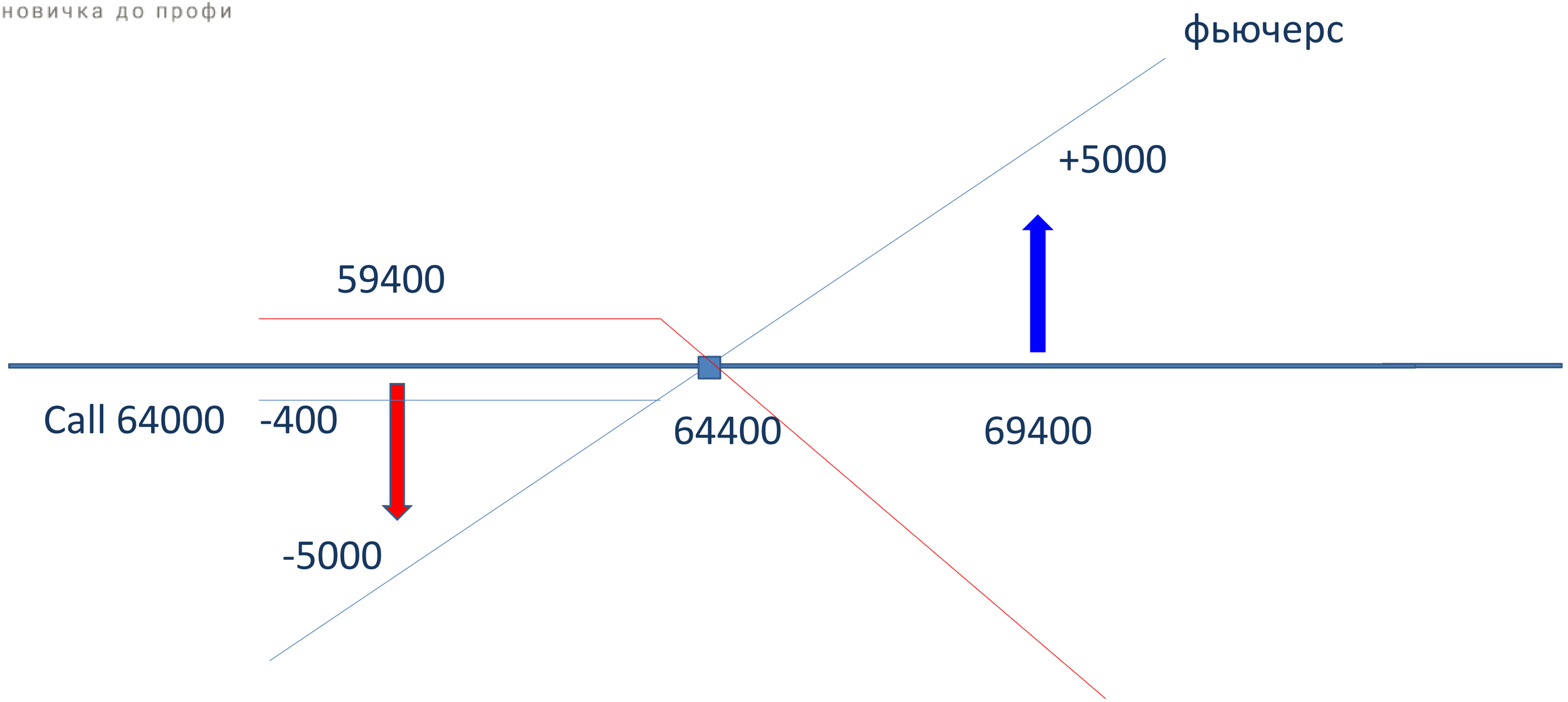
-5000

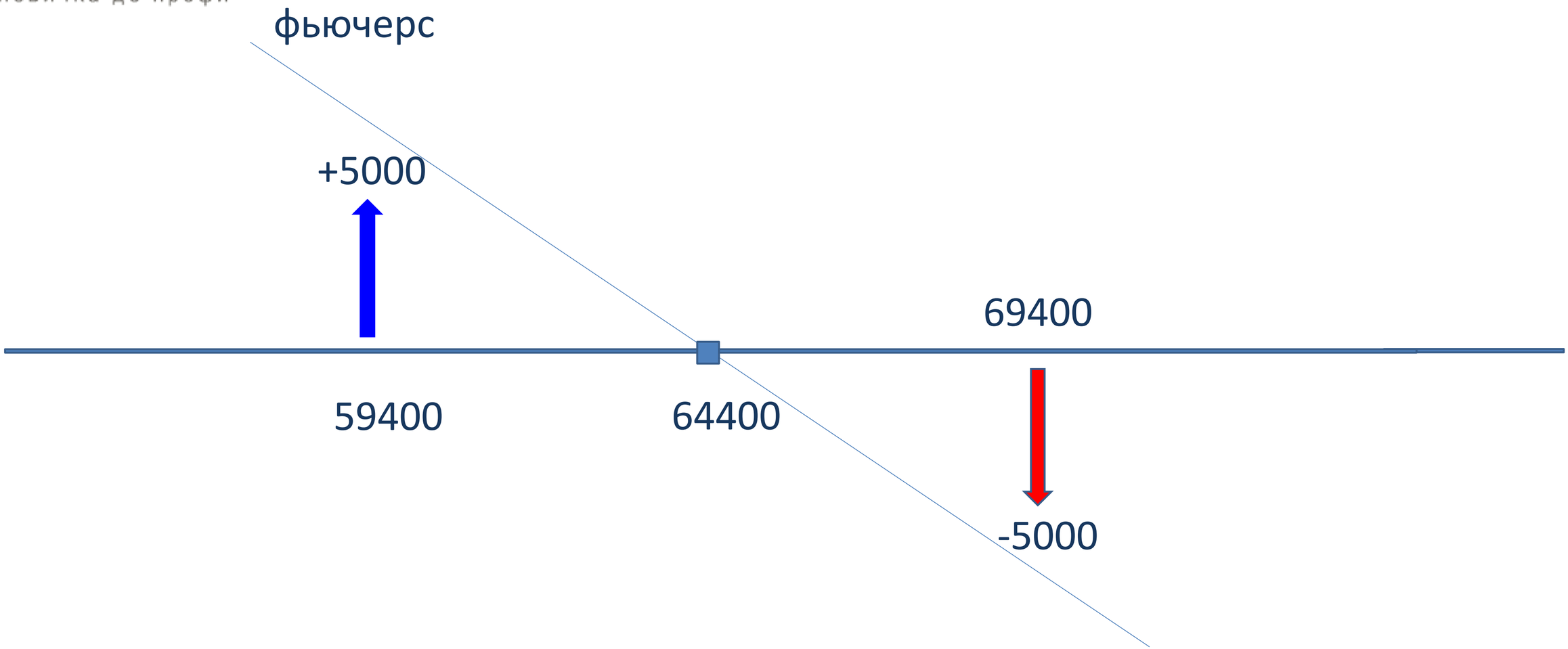


© shilintrade.com

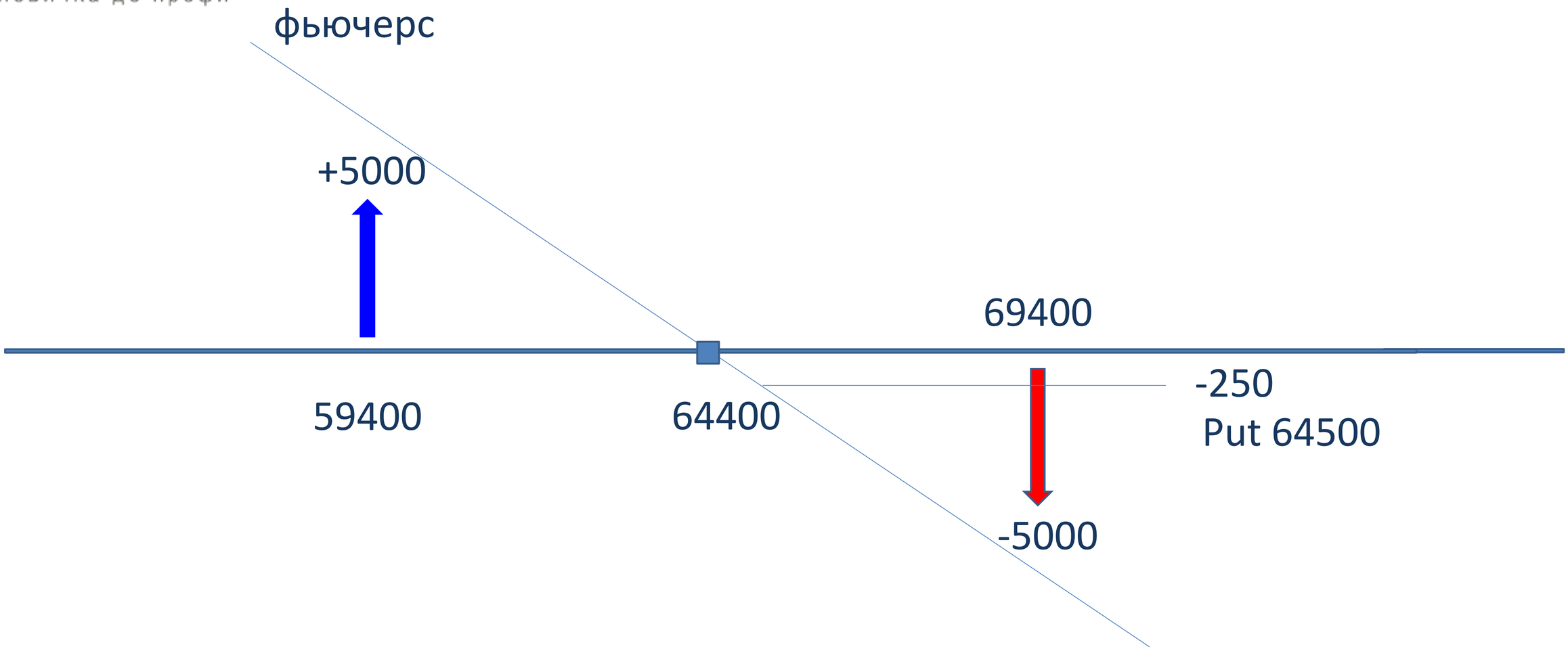


© shilintrade.com

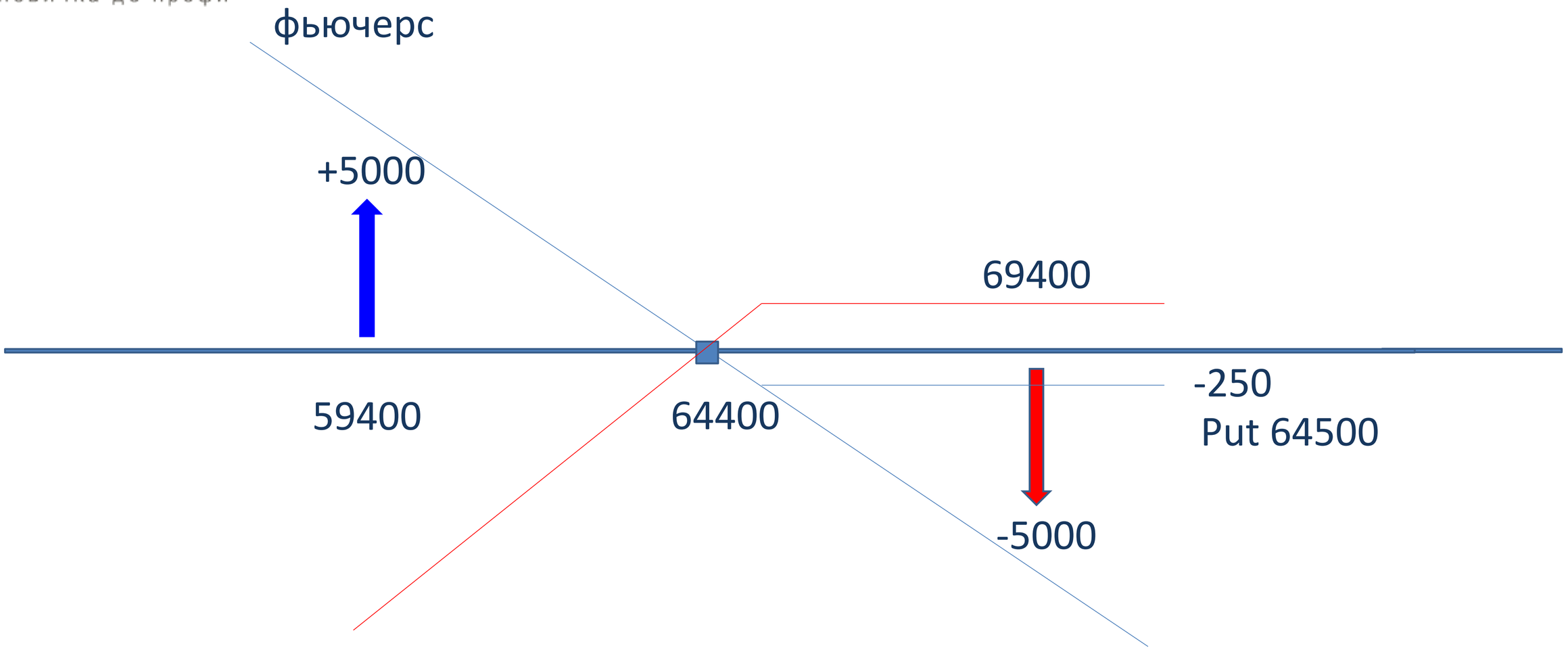

фьючерс
+5000
59400
Call 64000
-400
64400
69400
-5000



© shilintrade.com

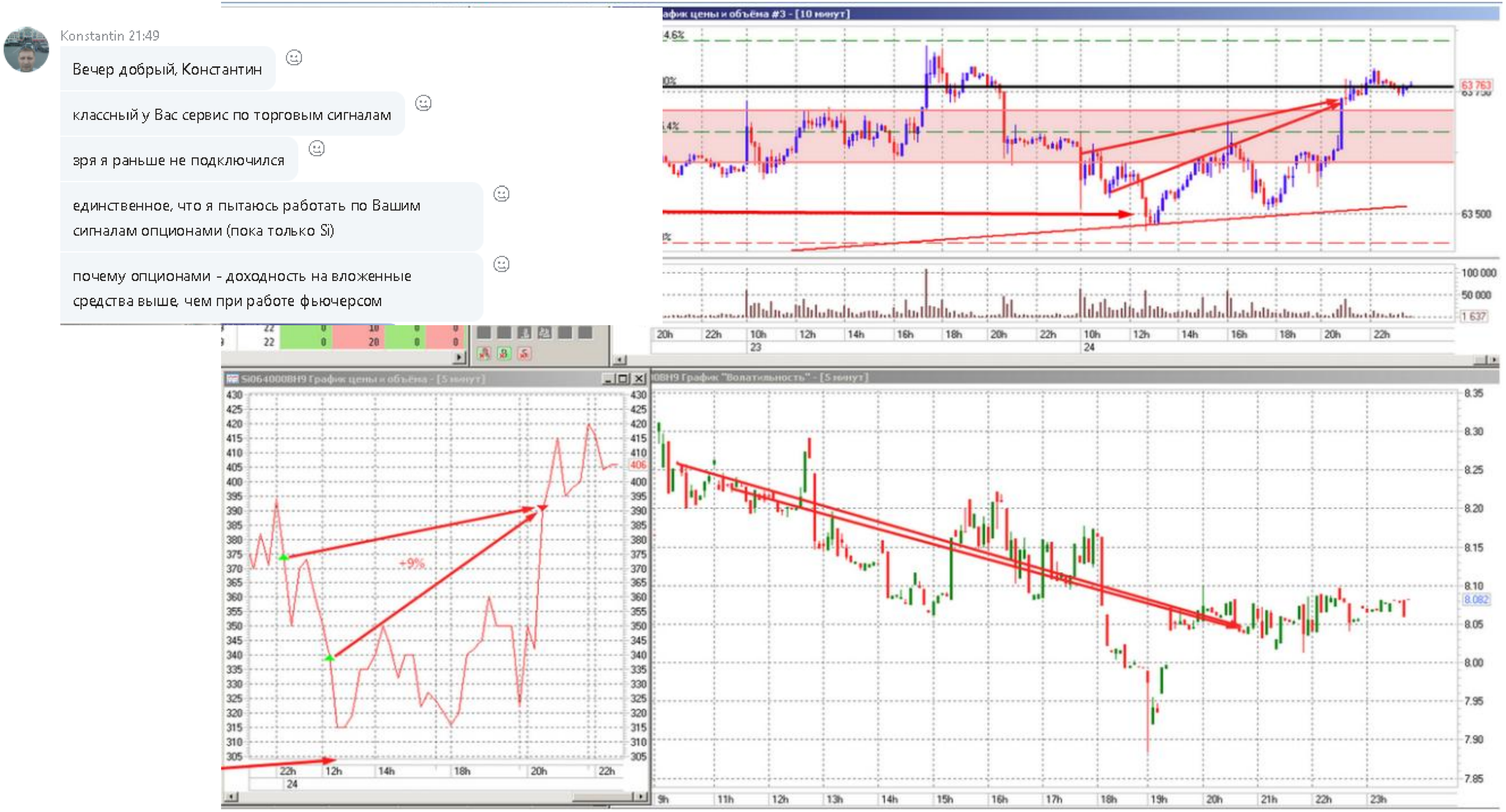


© shilintrade.com



© shilintrade.com

не нужны стопы



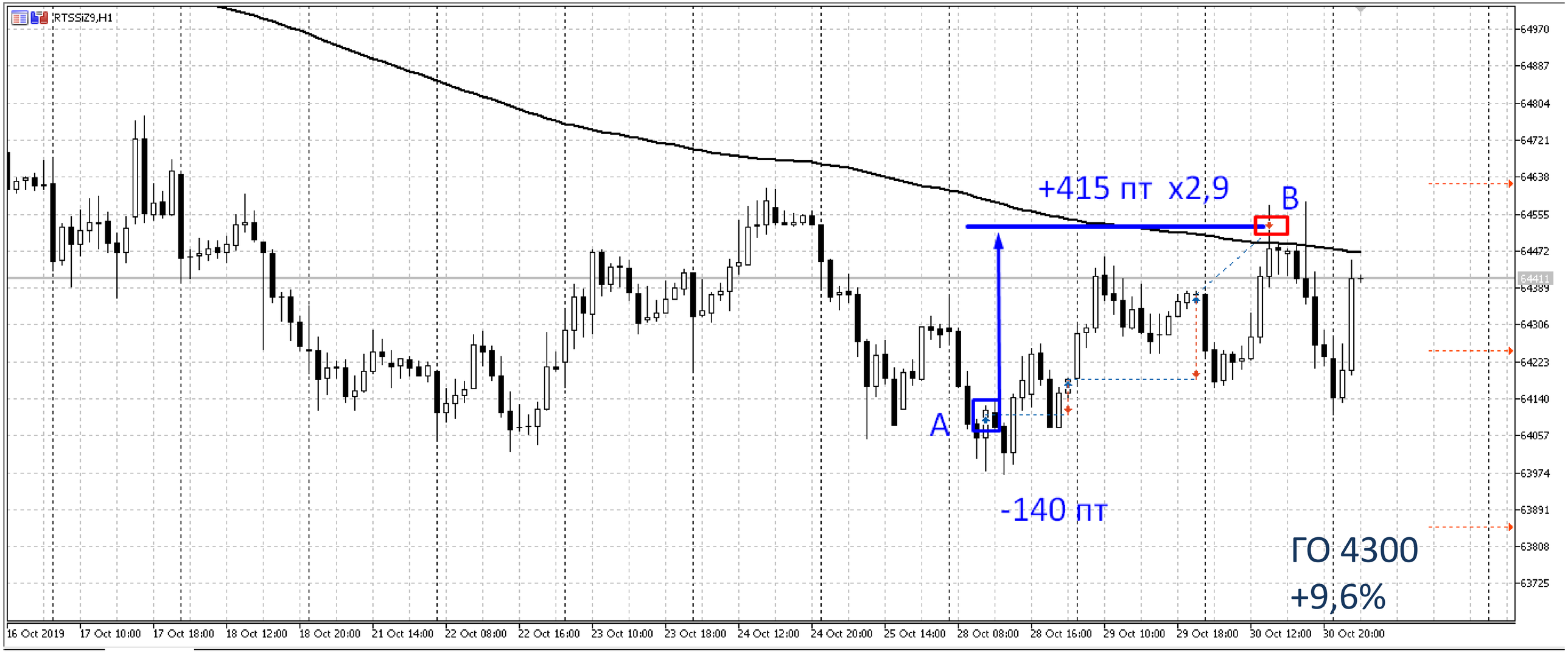
непривычность - нелинейность

Доска опционов [Si-12.19, 07.11.2019, ФОРТС опционы]

Si-12.19 | 07.11.2019 | Страйков: 50 | Посл.: 64 388 | Спрос: 64 389 | Предл: 64 386

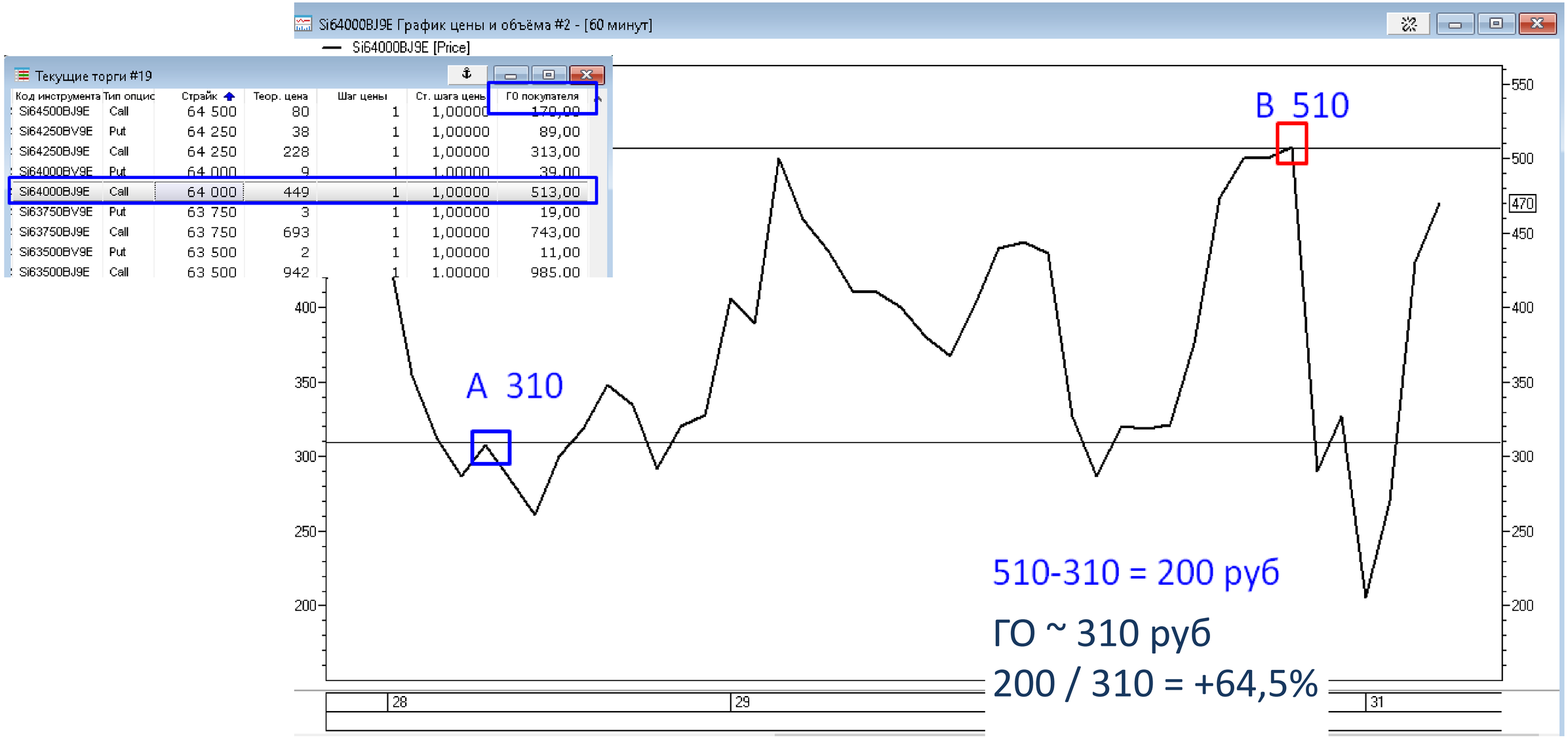
Открытых	Тэта CALL	Дельта CALL	Теор. цена CA	Внутр. ст-ть	Теор. цена CA	Страйк	Волатильность	Цена баз. ак	До испо	Теор. цена PU	Внутр. ст-ть	Дельта PUT	Тэта PUT	Открытых по
0	-3,20	0,01	6	0	6	68 500	19,054	64 391	7	4 119	4 109	-0,99	-3,20	0
0	-3,34	0,01	7	0	7	68 250	18,228	64 391	7	3 870	3 859	-0,99	-3,34	0
0	-3,50	0,01	7	0	7	68 000	17,396	64 391	7	3 620	3 609	-0,99	-3,50	0
0	-3,70	0,01	8	0	8	67 750	16,565	64 391	7	3 371	3 359	-0,99	-3,70	0
0	-3,94	0,02	9	0	9	67 500	15,740	64 391	7	3 122	3 109	-0,98	-3,94	0
0	-4,26	0,02	10	0	10	67 250	14,929	64 391	7	2 873	2 859	-0,98	-4,26	0
800	-4,68	0,02	11	0	11	67 000	14,138	64 391	7	2 624	2 609	-0,98	-4,68	0
0	-5,24	0,03	13	0	13	66 750	13,374	64 391	7	2 376	2 359	-0,97	-5,24	0
24	-6,01	0,03	16	0	16	66 500	12,646	64 391	7	2 129	2 109	-0,97	-6,01	0
0	-7,05	0,04	20	0	20	66 250	11,962	64 391	7	1 883	1 859	-0,96	-7,05	0
1 706	-8,46	0,06	27	0	27	66 000	11,331	64 391	7	1 640	1 609	-0,94	-8,46	0
2	-10,35	0,08	37	0	37	65 750	10,762	64 391	7	1 400	1 359	-0,92	-10,35	0
632	-12,78	0,12	54	0	54	65 500	10,264	64 391	7	1 167	1 109	-0,88	-12,78	110
1 012	-15,71	0,17	81	0	81	65 250	9,848	64 391	7	944	859	-0,83	-15,71	0
830	-18,84	0,24	122	0	122	65 000	9,523	64 391	7	735	609	-0,76	-18,84	10
32	-21,59	0,34	186	0	186	64 750	9,299	64 391	7	549	359	-0,66	-21,59	2
1 640	**-23,15**	**0,45**	**279**	**0**	**279**	**64 500**	**9,184**	**64 391**	**7**	**392**	**109**	**-0,55**	**-23,15**	**182**
136	-22,97	0,57	405	141	405	64 250	9,184	64 391	7	268	0	-0,43	-22,97	150
1 526	-21,07	0,68	564	391	564	64 000	9,302	64 391	7	177	0	-0,32	-21,07	916
0	-18,09	0,78	751	641	751	63 750	9,535	64 391	7	114	0	-0,22	-18,09	16
2	-14,83	0,85	961	891	961	63 500	9,877	64 391	7	74	0	-0,15	-14,83	462
0	-11,87	0,90	1 186	1 141	1 186	63 250	10,315	64 391	7	49	0	-0,10	-11,87	8
0	-9,44	0,93	1 420	1 391	1 420	63 000	10,835	64 391	7	33	0	-0,07	-9,44	3 116
0	-7,57	0,95	1 661	1 641	1 661	62 750	11,424	64 391	7	24	0	-0,05	-7,57	0
0	-6,17	0,96	1 904	1 891	1 904	62 500	12,073	64 391	7	17	0	-0,04	-6,17	72
0	-5,13	0,97	2 150	2 141	2 150	62 250	12,773	64 391	7	13	0	-0,03	-5,13	0
0	-4,38	0,98	2 398	2 391	2 398	62 000	13,522	64 391	7	11	0	-0,02	-4,38	2
0	-3,83	0,98	2 646	2 641	2 646	61 750	14,319	64 391	7	9	0	-0,02	-3,83	2
0	-3,44	0,99	2 895	2 891	2 895	61 500	15,161	64 391	7	8	0	-0,01	-3,44	0
0	-3,16	0,99	3 144	3 141	3 144	61 250	16,048	64 391	7	7	0	-0,01	-3,16	0
0	-2,97	0,99	3 393	3 391	3 393	61 000	16,977	64 391	7	6	0	-0,01	-2,97	0
0	-2,85	0,99	3 643	3 641	3 643	60 750	17,945	64 391	7	6	0	-0,01	-2,85	0
0	-2,78	0,99	3 892	3 891	3 892	60 500	18,948	64 391	7	5	0	-0,01	-2,78	0

© shilintrade.com



© shilintrade.com

не нужны стопы!!!



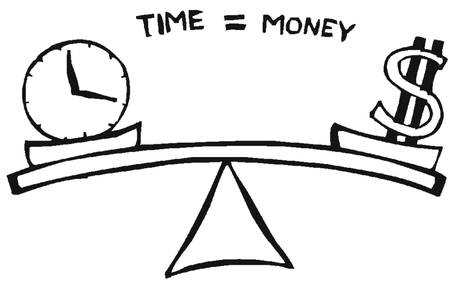
опцион
право купить/продать

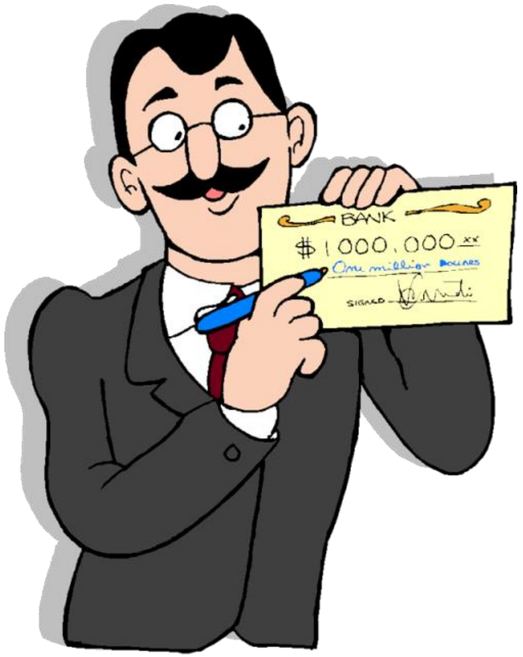
можно отказаться?

© shilintrade.com

ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
от новичка до профи

в чем подвох?



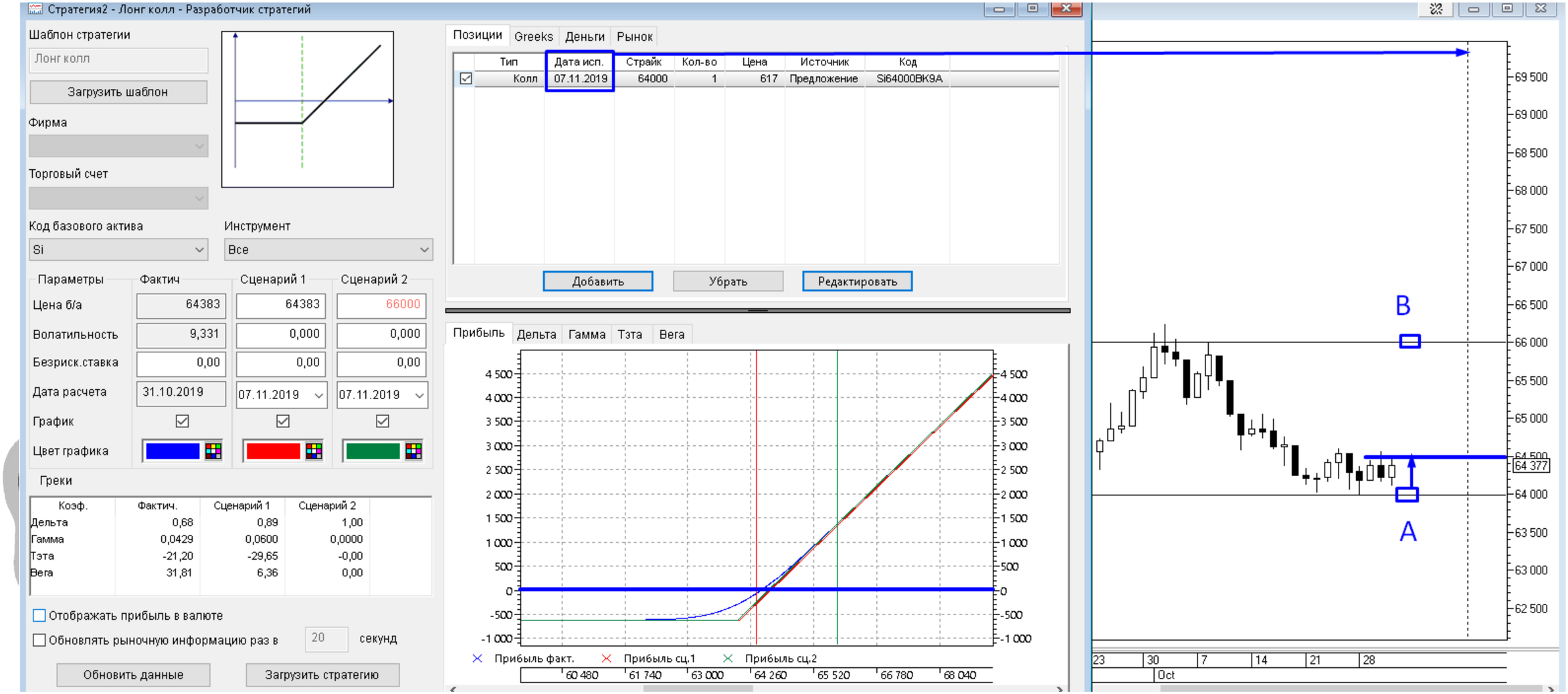


Доска опционов [Si-12.19, 07.11.2019, ФОРТС опционы]

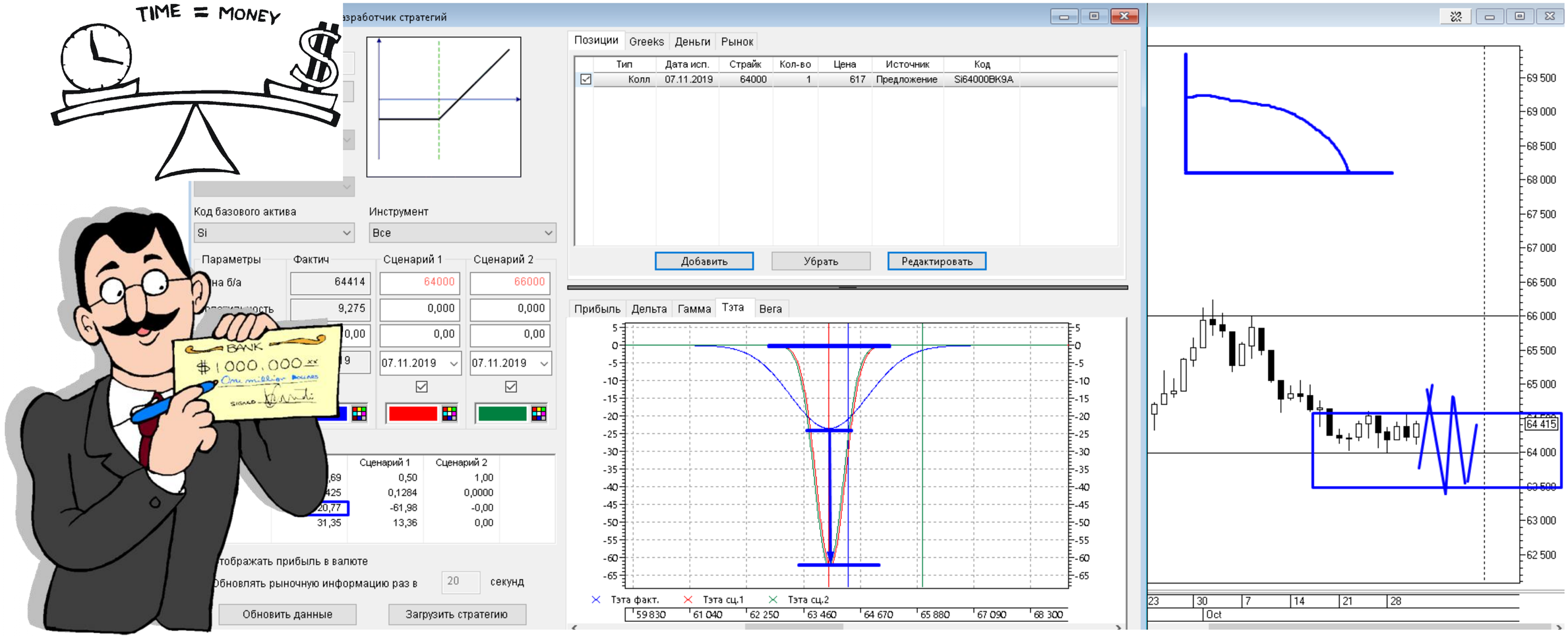
Si-12.19 | 07.11.2019 | Страйков: 50 | Посл.: 64 392 | Спрос: 64 392 | Предл: 64 388

Открытых	Тета CALL	Дельта CALL	Теор. цена CA	Внутр. ст-ть	Теор. цена CA	Страйк	Волатильность	Цена баз. ак	До испо	Теор. цена PU	Внутр. ст-ть	Дельта PUT	Тета PUT	Открытых по
0	-3,18	0,01	6	0	6	68 500	19,054	64 387	7	4 119	4 113	-0,99	-3,18	0
0	-3,32	0,01	7	0	7	68 250	18,227	64 387	7	3 870	3 863	-0,99	-3,32	0
0	-3,48	0,01	7	0	7	68 000	17,395	64 387	7	3 620	3 613	-0,99	-3,48	0
0	-3,68	0,01	8	0	8	67 750	16,564	64 387	7	3 371	3 363	-0,99	-3,68	0
0	-3,92	0,02	9	0	9	67 500	15,740	64 387	7	3 122	3 113	-0,98	-3,92	0
0	-4,23	0,02	10	0	10	67 250	14,928	64 387	7	2 873	2 863	-0,98	-4,23	0
800	-4,65	0,02	11	0	11	67 000	14,137	64 387	7	2 624	2 613	-0,98	-4,65	0
0	-5,21	0,03	13	0	13	66 750	13,374	64 387	7	2 376	2 363	-0,97	-5,21	0
24	-5,97	0,03	16	0	16	66 500	12,646	64 387	7	2 129	2 113	-0,97	-5,97	0
0	-7,00	0,04	20	0	20	66 250	11,962	64 387	7	1 883	1 863	-0,96	-7,00	0
1 706	-8,41	0,06	27	0	27	66 000	11,330	64 387	7	1 640	1 613	-0,94	-8,41	0
2	-10,29	0,08	37	0	37	65 750	10,761	64 387	7	1 400	1 363	-0,92	-10,29	0
632	-12,72	0,12	54	0	54	65 500	10,264	64 387	7	1 167	1 113	-0,88	-12,72	110
1 012	-15,64	0,17	81	0	81	65 250	9,848	64 387	7	944	863	-0,83	-15,64	0
830	-18,78	0,24	122	0	122	65 000	9,523	64 387	7	735	613	-0,76	-18,78	10
32	-21,54	0,33	186	0	186	64 750	9,299	64 387	7	549	363	-0,67	-21,54	2
1 640	**-23,13**	**0,45**	**279**	**0**	**279**	**64 500**	**9,184**	**64 387**	**7**	**392**	**113**	**-0,55**	**-23,13**	**182**
136	-22,99	0,57	405	137	405	64 250	9,184	64 387	7	268	0	-0,43	-22,99	150
1 526	-21,12	0,68	564	387	564	64 000	9,302	64 387	7	177	0	-0,32	-21,12	916
0	-18,16	0,78	751	637	751	63 750	9,535	64 387	7	114	0	-0,22	-18,16	16
2	-14,90	0,85	961	887	961	63 500	9,877	64 387	7	74	0	-0,15	-14,90	462
0	-11,93	0,90	1 186	1 137	1 186	63 250	10,315	64 387	7	49	0	-0,10	-11,93	8
0	-9,50	0,93	1 420	1 387	1 420	63 000	10,835	64 387	7	33	0	-0,07	-9,50	3 116
0	-7,62	0,95	1 661	1 637	1 661	62 750	11,424	64 387	7	24	0	-0,05	-7,62	0
0	-6,21	0,96	1 904	1 887	1 904	62 500	12,072	64 387	7	17	0	-0,04	-6,21	72
0	-5,17	0,97	2 150	2 137	2 150	62 250	12,773	64 387	7	13	0	-0,03	-5,17	0
0	-4,41	0,98	2 398	2 387	2 398	62 000	13,522	64 387	7	11	0	-0,02	-4,41	2
0	-3,85	0,98	2 646	2 637	2 646	61 750	14,318	64 387	7	9	0	-0,02	-3,85	2
0	-3,46	0,99	2 895	2 887	2 895	61 500	15,161	64 387	7	8	0	-0,01	-3,46	0
0	-3,18	0,99	3 144	3 137	3 144	61 250	16,047	64 387	7	7	0	-0,01	-3,18	0
0	-2,99	0,99	3 393	3 387	3 393	61 000	16,976	64 387	7	6	0	-0,01	-2,99	0
0	-2,87	0,99	3 643	3 637	3 643	60 750	17,944	64 387	7	6	0	-0,01	-2,87	0
0	-2,79	0,99	3 892	3 887	3 892	60 500	18,947	64 387	7	5	0	-0,01	-2,79	0

в чем подвох?

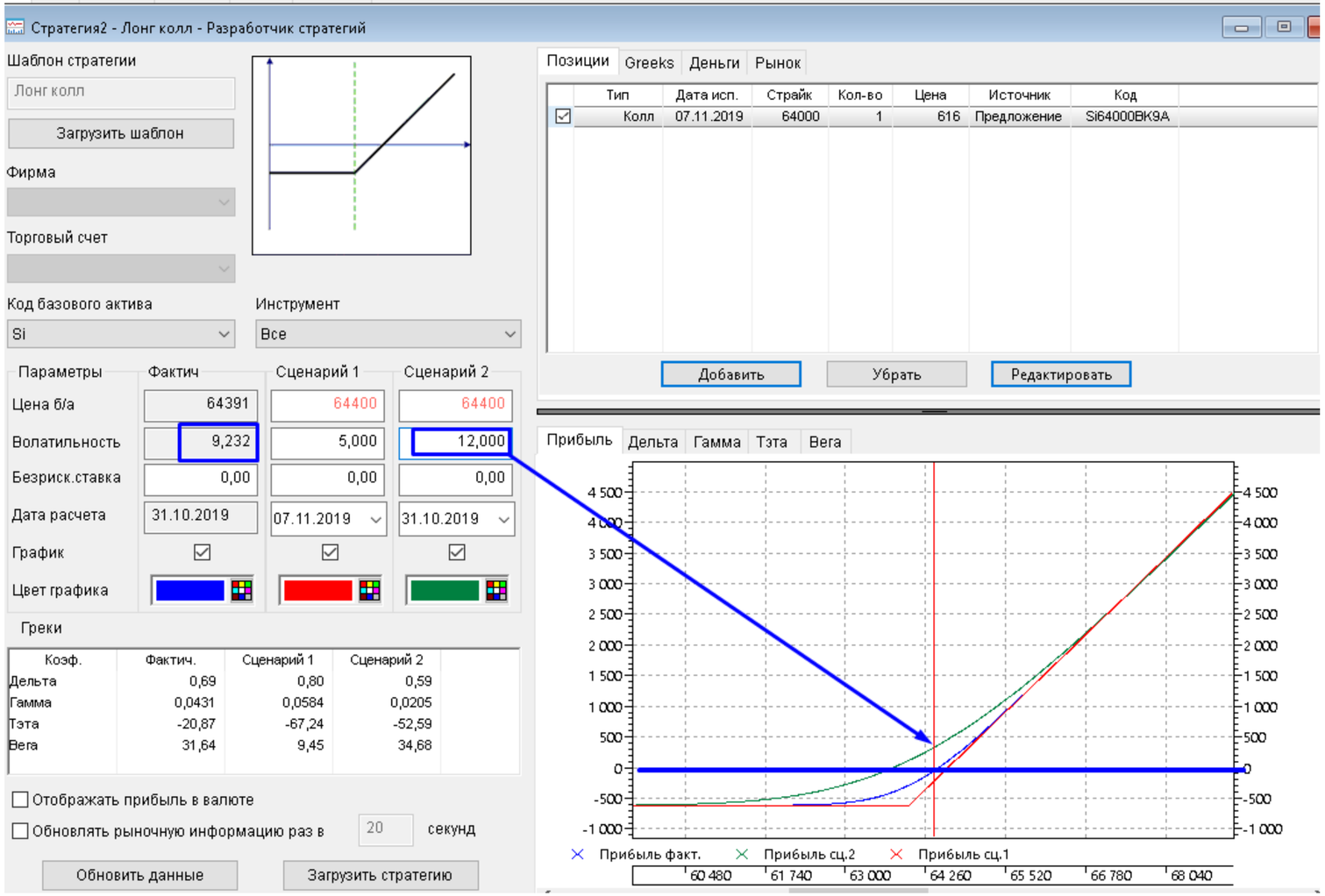

Стратегия2 - Лонг колл - Разработчик стратегий
Шаблон стратегии
Лонг колл
Загрузить шаблон
Фирма
Торговый счет
Код базового актива
Si
Инструмент
Все
Параметры
Фактич
Сценарий 1
Сценарий 2
Цена б/а
64383
64383
66000
Волатильность
9,331
0,000
0,000
Безриск.ставка
0,00
0,00
0,00
Дата расчета
31.10.2019
07.11.2019
07.11.2019
График
Цвет графика
Греки
Коэф.
Фактич.
Сценарий 1
Сценарий 2
Дельта
0,68
0,89
1,00
Гамма
0,0429
0,0600
0,0000
Тэта
-21,20
-29,65
-0,00
Вега
31,81
6,36
0,00
Отображать прибыль в валюте
Обновлять рыночную информацию раз в
20
секунд
Обновить данные
Загрузить стратегию
Позиции
Greeks
Деньги
Рынок
Тип
Дата исп.
Страйк
Кол-во
Цена
Источник
Код
Колл
07.11.2019
64000
1
617
Предложение
Si64000BK9A
Добавить
Убрать
Редактировать
Прибыль
Дельта
Гамма
Тэта
Вега
Прибыль факт.
Прибыль сц.1
Прибыль сц.2
B
A
64 377
Oct

в чем подвох?


TIME = MONEY
Позиции
Greeks
Деньги
Рынок
Тип
Дата исп.
Страйк
Кол-во
Цена
Источник
Код
Колл
07.11.2019
64000
1
617
Предложение
Si64000BK9A
Добавить
Убрать
Редактировать
Код базового актива
Si
Инструмент
Все
Параметры
Фактич
Сценарий 1
Сценарий 2
64414
64000
66000
9,275
0,000
0,000
0,00
0,00
0,00
07.11.2019
07.11.2019
Прибыль
Дельта
Гамма
Тэта
Вега
Тэта факт.
Тэта сц.1
Тэта сц.2
Отображать прибыль в валюте
Обновлять рыночную информацию раз в
20
секунд
Обновить данные
Загрузить стратегию
64 415
Oct

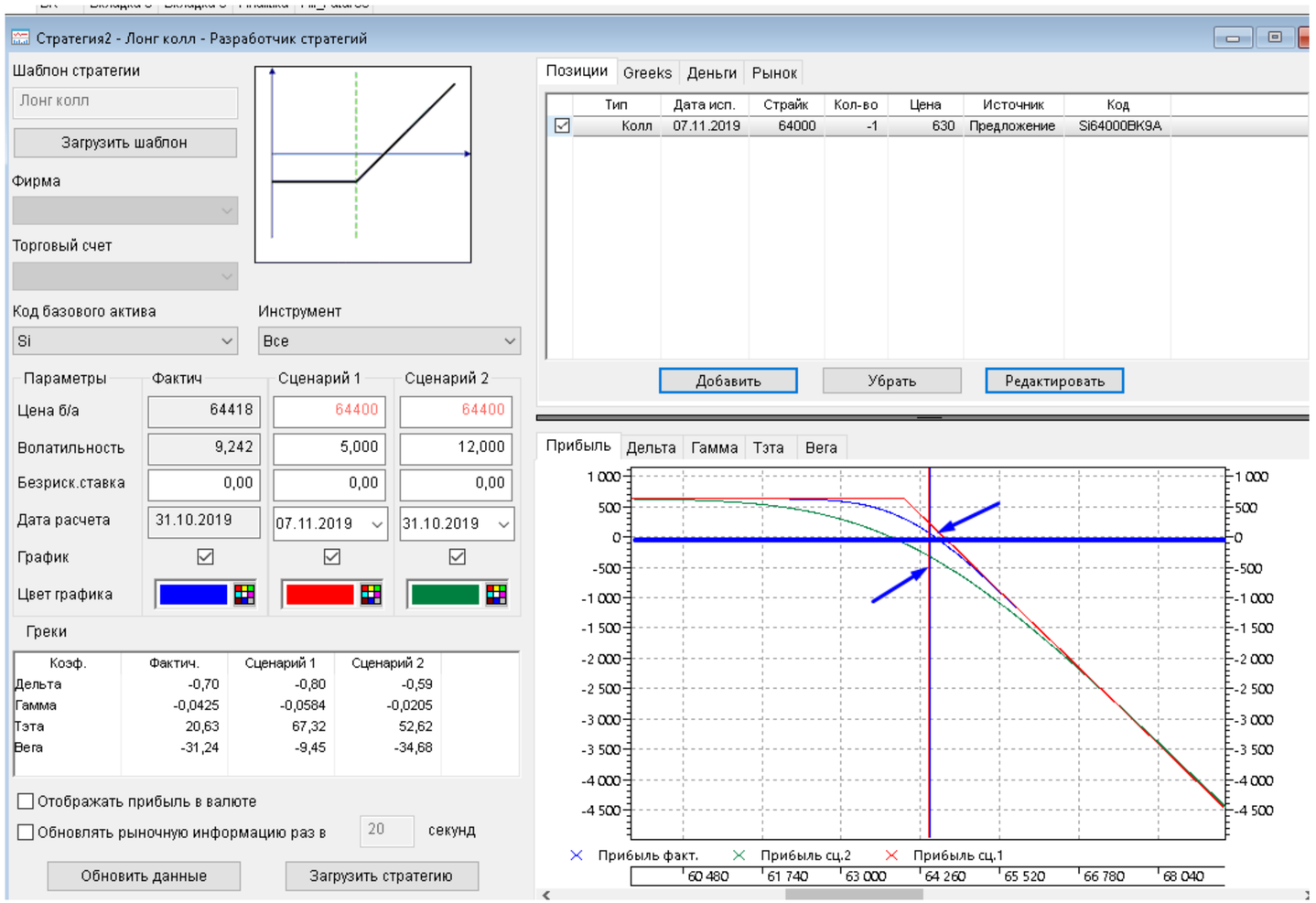
в чем подвох?

Волатильность опционов

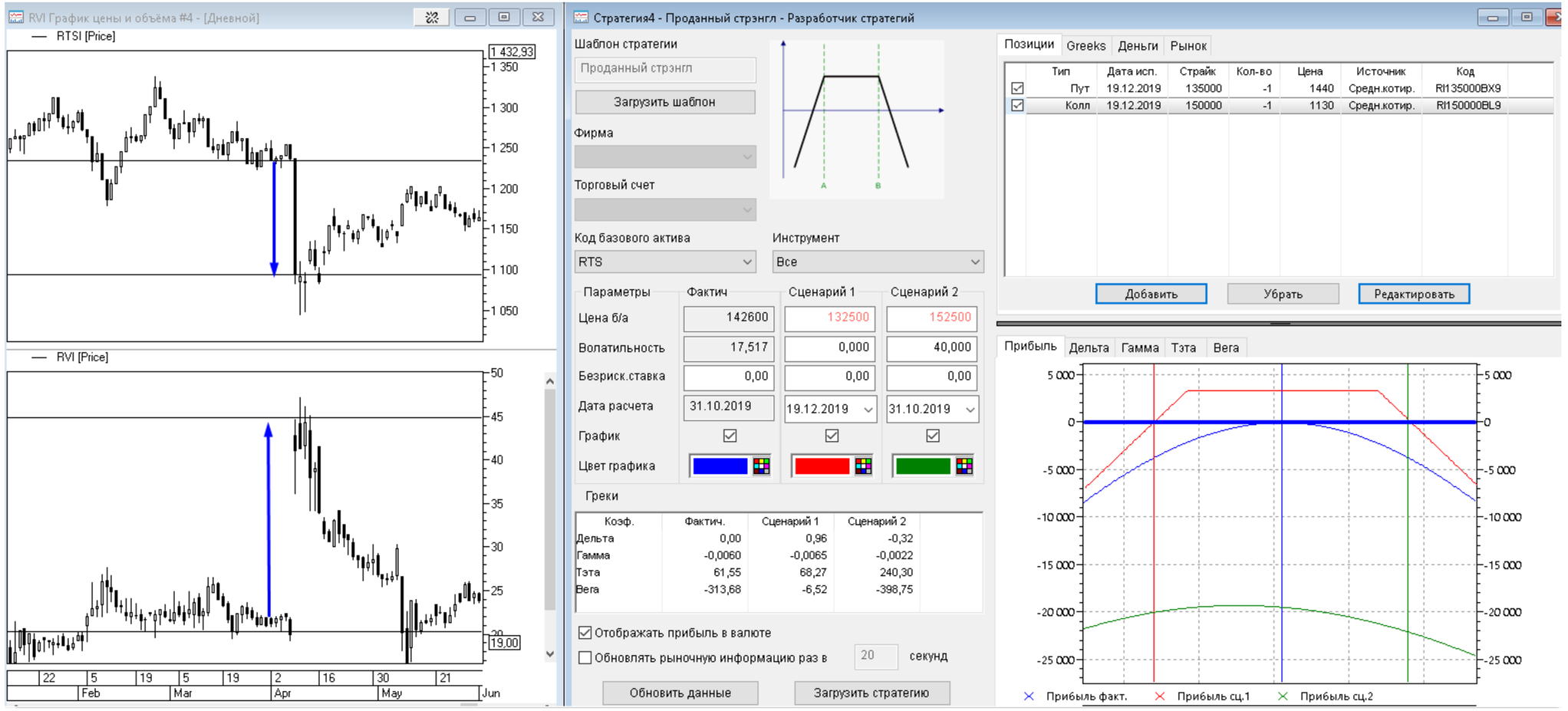


в чем подвох?

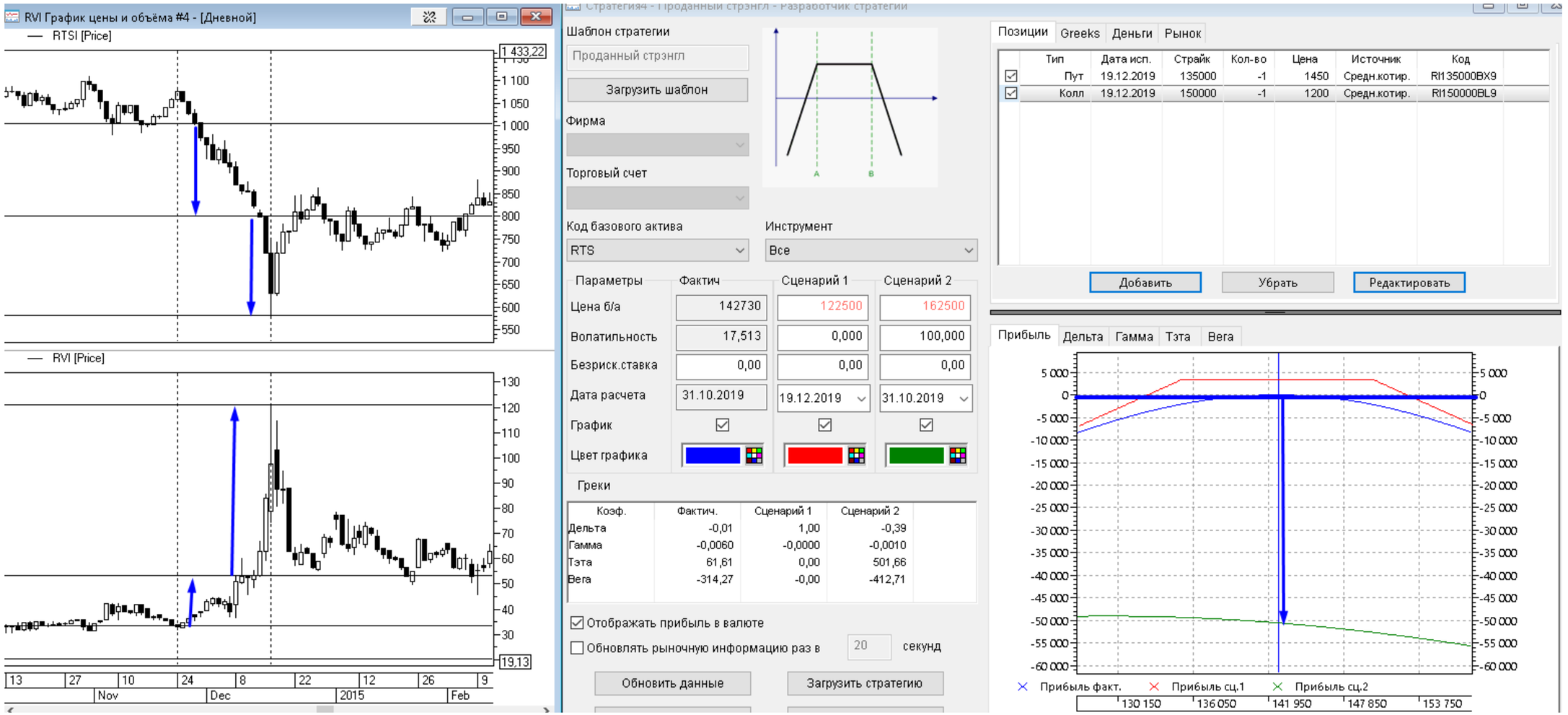
Волатильность опционов



Волатильность опционов



Волатильность опционов



в чем подвох?

Option chart strategy - RTS-6.18_FT LAFT Option-lab
PnL -2 980 132
D 221.678
G -1.6993
T 50616.07
V -168386.91
Calc Date: 10.04.2018
Market
--3D--
Refresh
Online
Refresh IV
Position's
Statistic's
Setting's
RTS-6.18 107730
GM: 19 005 121.45
TPremium: -3451005.12
Debit: -1367367.52
CS IV: 0
Shift IV: 0
Date:LIVE RTS-6.18_FT:162516 P/L:-6528840.00 Delta:-237.437 Gamma:-0.3564 Theta:11494 Vega:-55255
LIVE
28.04.2018-14:45
16.05.2018-14:45
03.06.2018-14:45

Резюме

	продавец		покупатель	
	Call	Put	Call	Put
Актив растет	∞ «-»	«+»	∞ «+»	«-»
Актив снижается	«+»	∞ «-»	«-»	∞ «+»
Время	«+»	«+»	«-»	«-»
Волатильность растет	«-»	«-»	«+»	«+»
Волатильность снижается	«+»	«+»	«-»	«-»

© shilintrade.com

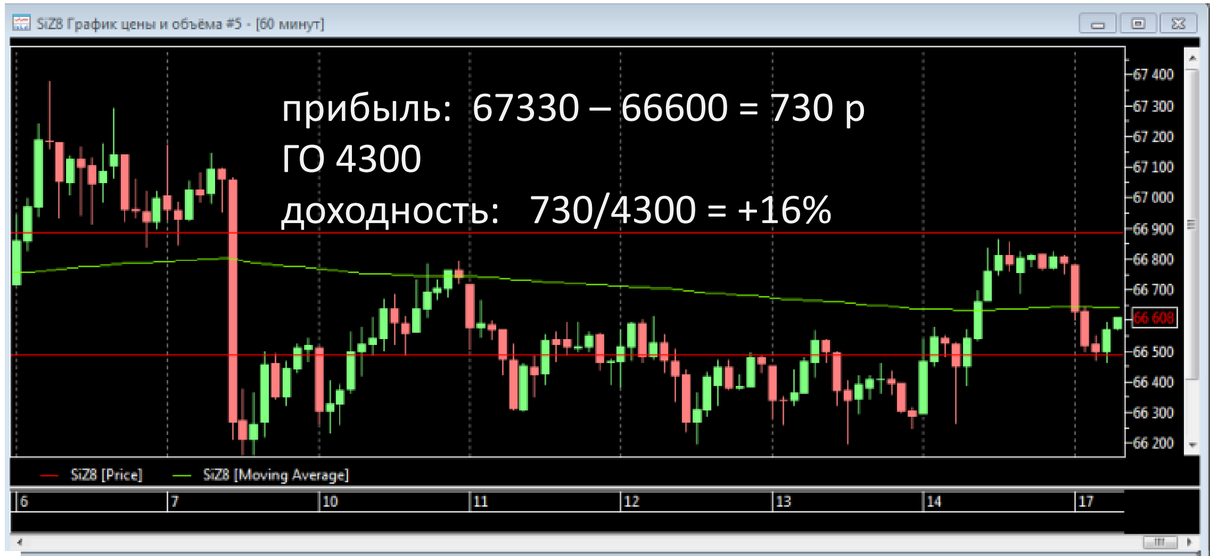
SiZ8 График цены и объёма #5 - [60 минут]
SiZ8 [Price]
SiZ8 [Moving Average]

Si066500BL8 График цены и объёма - [60 минут]
купил 66 500 по 390
Si066500BL8 [Price]

SiZ8 График цены и объёма #5 - [60 минут]
SiZ8 [Price]
SiZ8 [Moving Average]

вышел по 840
впереди уровень и экспирация через 2 дня
Si066500BL8 [Price]

не нужны стопы!!!



преимущества опционов

-низкая капиталоемкость (ГО под премию)

-выше доходность

-не нужно ставить стопы

- отлично подходят для торговли лимитками

-не нужен точный стоп

-легко трансформировать позицию в противоположную или безубыточную

недостатки опционов для покупателя

- ниже ликвидность

- больше спред

- необходимо учитывать время жизни опциона

- рост волатильности может уменьшить доход

- рост ГО при резких движениях

© shilintrade.com

причины неудач

-низкая капиталоемкость опциона – работа на все депо
(покупка опционов на все ГО фючерса)
-не адекватный идее срок опциона
- не адекватный идее страйк опциона
- не адекватные вероятности риски (покупка вне денег)
- неисполнение алгоритма сделки (предсказания исхода сделки)

© shilintrade.com

преимущества опционов

-низкая капиталоемкость (ГО под премию)

-выше доходность

-не нужно ставить стопы

- отлично подходят для торговли лимитками

-не нужен точный стоп

-легко трансформировать позицию в противоположную или безубыточную

недостатки опционов для покупателя – как исправить

- ~~ниже ликвидность~~ - синтетические конструкции с фьючерсом
- ~~больше спред~~ - выбор ликвидных опционов + фьючерсов для закрытия/открытия сделки
  + работа в стакане вблизи теоретической цены
- ~~необходимо учитывать время жизни опциона~~ - хеджируем временной распад
- ~~рост волатильности может уменьшить доход~~ - хеджируем волатильность
- рост ГО при резких движениях - не покупаем на все депо и считаем риски ;)

© shilintrade.com

Кому подходит

- у кого частые стопы в точке входа, но аналитика верная

- склонным к тильту и не терпимых к риску трейдерам

- у кого нет времени на точный вход

- кто не может ставить стопы

- кому нравится спокойная торговля

- кто любит прогнозируемый риск
  или не может переносить позиции через ночь или выходные

- кто хочет хеджировать инвестпортфели

© shilintrade.com

ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
Константина Шилина
НАУЧИСЬ ЗАРАБАТЫВАТЬ
НА ОПЦИОНАХ ЗА МЕСЯЦ
Практический онлайн-курс
Начало: 11 ноября 2019 года
в 19:00 МСК
Plan B
Опционы

Что будем внедрять

- базовая модель регулярного дохода

- бонусная модель сверх-доходности

© shilintrade.com

Что будем внедрять

- базовая модель регулярного дохода

- бонусная модель сверх-доходности

В формате пошаговых алгоритмов научимся:

- однозначно определять в какую сторону открываться

- выбирать правильный опцион (тип, страйк, срок, премия)

- оценивать и считать риски предполагаемой сделки

- выбирать время совершения сделки

- технически покупать и продавать опционы в рамках стратегии

- трансформировать сделку при неблагоприятных сценариях

© shilintrade.com

ШКОЛА ТРЕЙДИНГА
от новичка до профи

Что будем внедрять

- базовая модель регулярного дохода

- бонусная модель сверх-доходности

Что это даст

5..20% в месяц

В формате пошаговых алгоритмов научимся:

- однозначно определять в какую сторону открываться

- выбирать правильный опцион (тип, страйк, срок, премия)

- оценивать и считать риски предполагаемой сделки

- выбирать время совершения сделки

- технически покупать и продавать опционы в рамках стратегии

- трансформировать сделку при неблагоприятных сценариях

За счет чего?

- нивелирование «трейдерского зуда»

- отсутствия физических стопов

- прогнозированного риска

- повышения вероятности выхода сделки в «+»

- гибкости трансформации позиции
  и вывод убыточной сделки в «+»

- возможности не пропускать и удерживать движения, особенно через праздники

© shilintrade.com

..Я смотрю за плюсами опционов. Риски меньше. И сидишь спокойно, не думаешь: "0,1% через ночь/ выходные переносить или всю позицию. Не нужно точно входить и стоп 100% ограничен при длинных позициях и спредах.

Александр –

Инструмент интересный. Со своими преимуществами.

– Владимир

...Хороший курс! Все понятно и доступно. До этого курса мой опыт в торговле составлял 2 месяца и этого опыта мне оказалось достаточно, чтобы разобраться в торговле опционами в этом курсе. Опционы позволяют торговать в более комфортном психологическом уровне, минимизировать риски.

Александр –

© shilintrade.com

КАК БУДЕТ ПРОХОДИТЬ ОБУЧЕНИЕ?

ТЕОРЕТИЧЕСКИЙ БЛОК

Теоретические занятия будут проходить два раза в неделю в 19:00 МСК. Материал можно изучать в записи.

МАСТЕР- ГРУППЫ

Все участники будут добавлены в чат, в котором смогут наблюдать сигналы онлайн, подготовку торговых идей, а также задать вопросы.

ИНДИВИДУАЛЬНАЯ РАБОТА

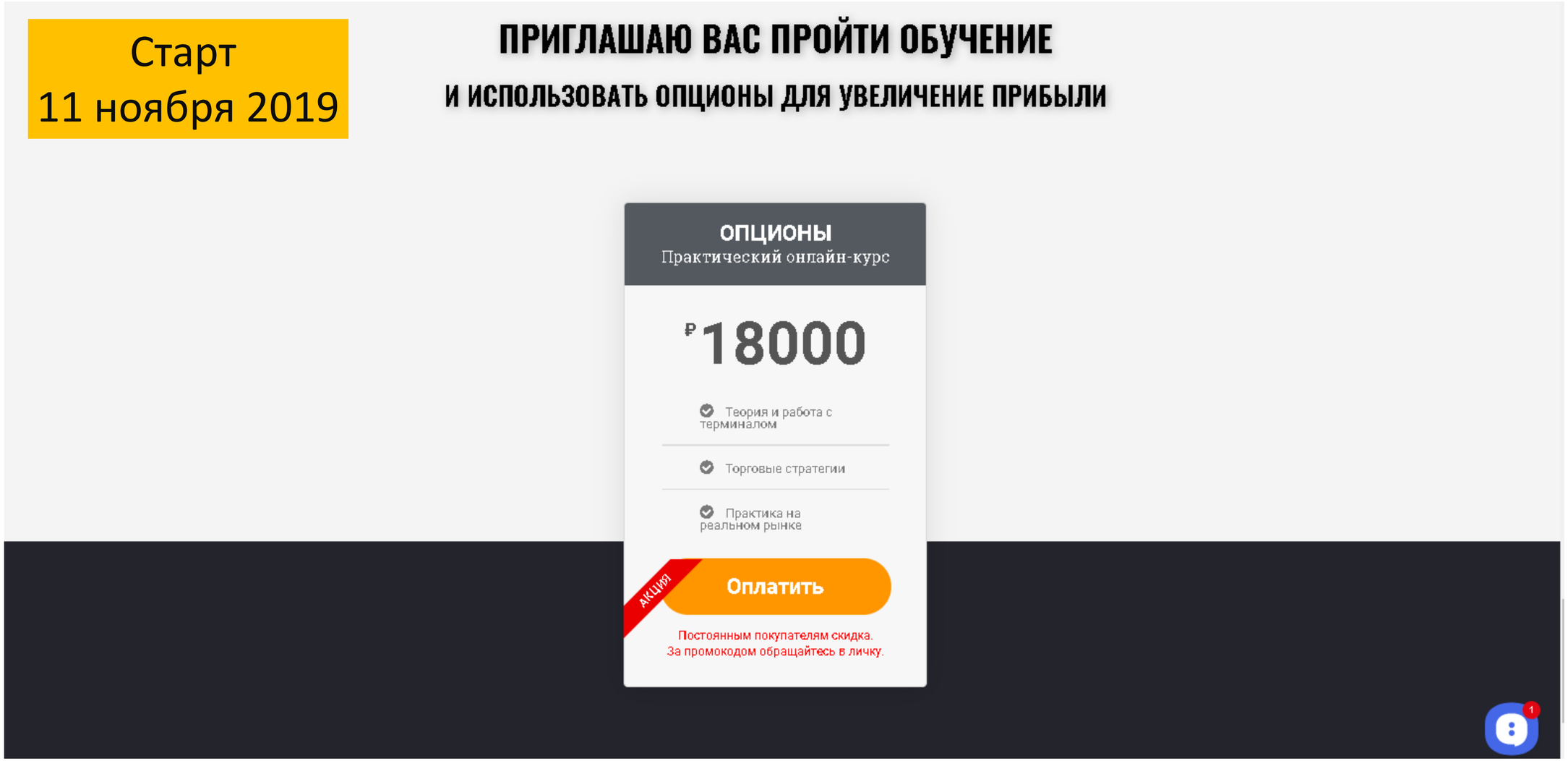
Проверка домашних заданий по каждому блоку. Проверка сделок. Анализ и рекомендации. Два звонка по 30 минут в удобное время.

ПОДДЕРЖКА ПОСЛЕ ОБУЧЕНИЯ

Проверка дневника через месяц, ответы на вопросы, Сопровождение торгового чата в течение месяца.

© shilintrade.com

Старт
11 ноября 2019

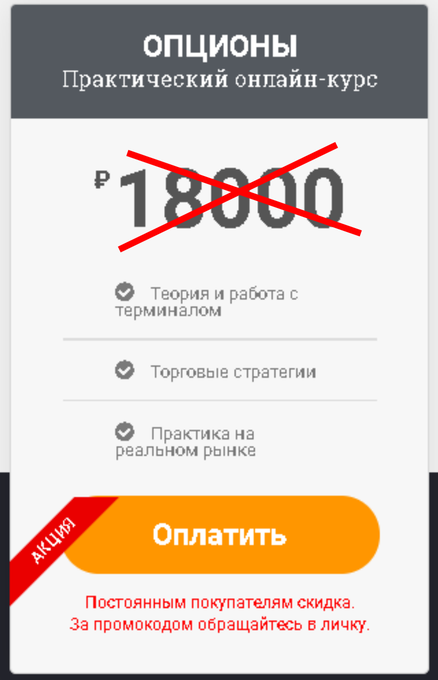


Старт
11 ноября 2019

ПРИГЛАШАЮ ВАС ПРОЙТИ ОБУЧЕНИЕ

И ИСПОЛЬЗОВАТЬ ОПЦИОНЫ ДЛЯ УВЕЛИЧЕНИЕ ПРИБЫЛИ

Купон:
«options0211»
на 8 300 руб
до 02.11.19
подпишись за
9 700 руб



Купон:
«options0711»
на 6 300 руб
до 07.11.19
подпишись за
11 700 руб