

Intraday Master Teorie

Obsah

- Nastavení účtu pro intradenní trading
- Páka oproti akciím
- Opce a časový úpadek
- Jaké opce kupuji (rozdíl mezi ATM, OTM a ITM)
- Gamma
- Volume u opcí
- Volatilita
- Seznam akcií - můj watchlist pro každý den
- Scalp vs Intradenní swing
- Časové rámce, které pro intradenní obchody používám
- Postup pro analýzu - od vysokého grafu po nízký (zakreslení SR úrovní)
- V jaké hodiny zadávat obchody a kdy naopak neobchodovat
- Cenové patterny pro každý den (trojúhelník, vlajka, 123 pattern, breaky, odrazy od supportů a rezistencí)
- Objemy akcií

Obsah

- Pre-Earnings intradenní setupy
- Post-Earnings intradenní setupy
- Zprávy - jak je číst a použít pro intradenní obchody
- Jak číst Internals, co jsou to Ticky, co je Vix
- Kdy vystupovat z obchodů
- Money Management a riziko
- Sestavení obchodního plánu
- Psychologie
- Příprava a nastavení platformy pro intradenní obchodování

Nastavení účtu pro Intradenní trading

Pokud máte účet pod 25 000 USD, pak zvolte **CASH** (nezapomeňte, že **než se hotovost tzv. usadí, tak to u opcí zabere 1 den, u akcií 2 dny**)

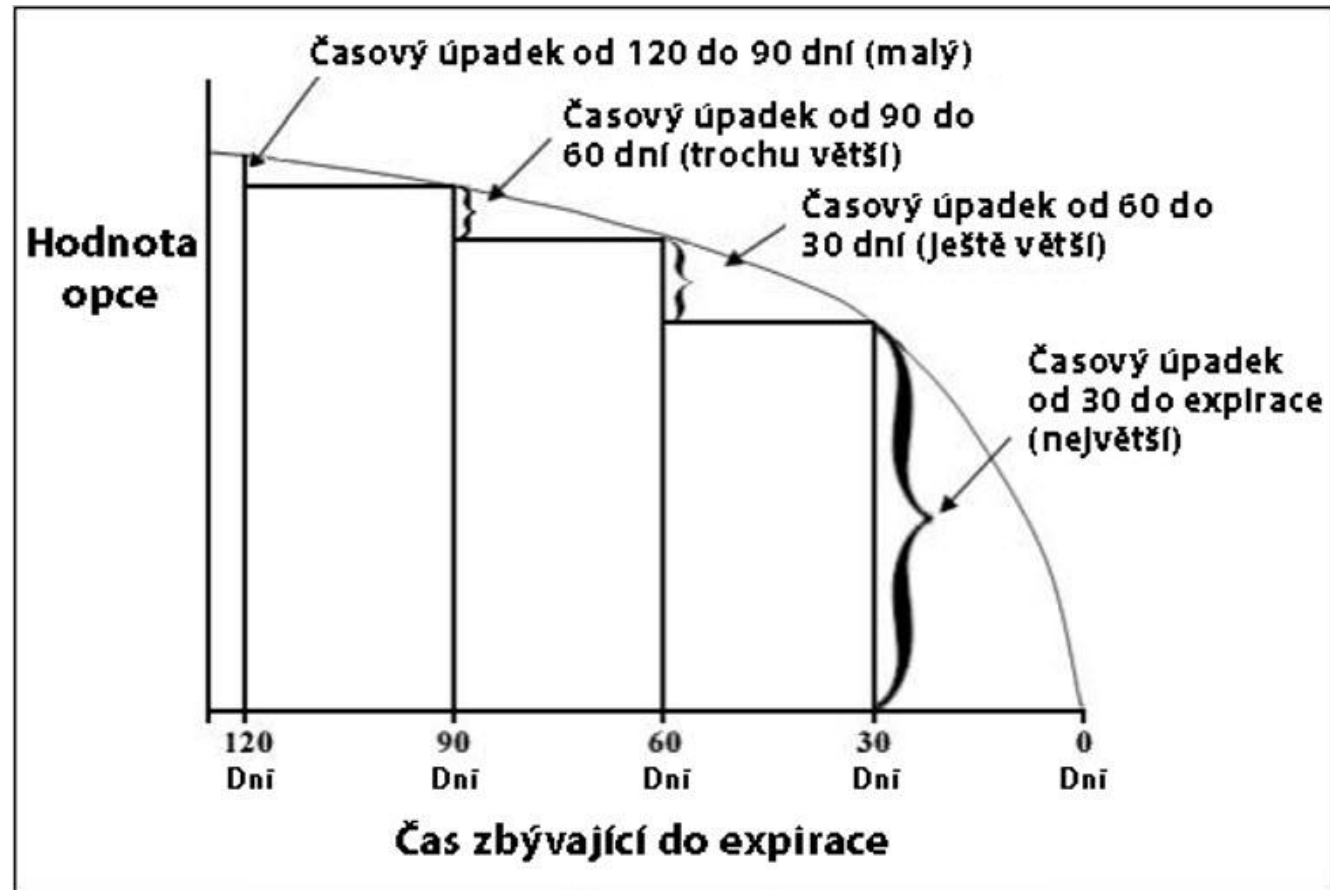
Pokud máte účet nad 25 000 USD, pak můžete mít **MARGIN**

TastyWorks, TradeStation, Interactive broker

Páka u opcí

- 1 opce = 100 akcí
- Pokud spekulují na **vzestup akcie**, tak kupují **call opce**
- Pokud spekulují na **pokles akcie**, tak kupují **put opce**
- Vysvětlit a ukázat v platformě...

Časový úpadek opcí



Pozor na časový úpadek u intraday swingů v posledních dnech

Pokud budete vstupovat do Intradenních swingů v den expirace a v obchodu budete moc dlouho, tak opce rapidně ztrácí svůj čas!

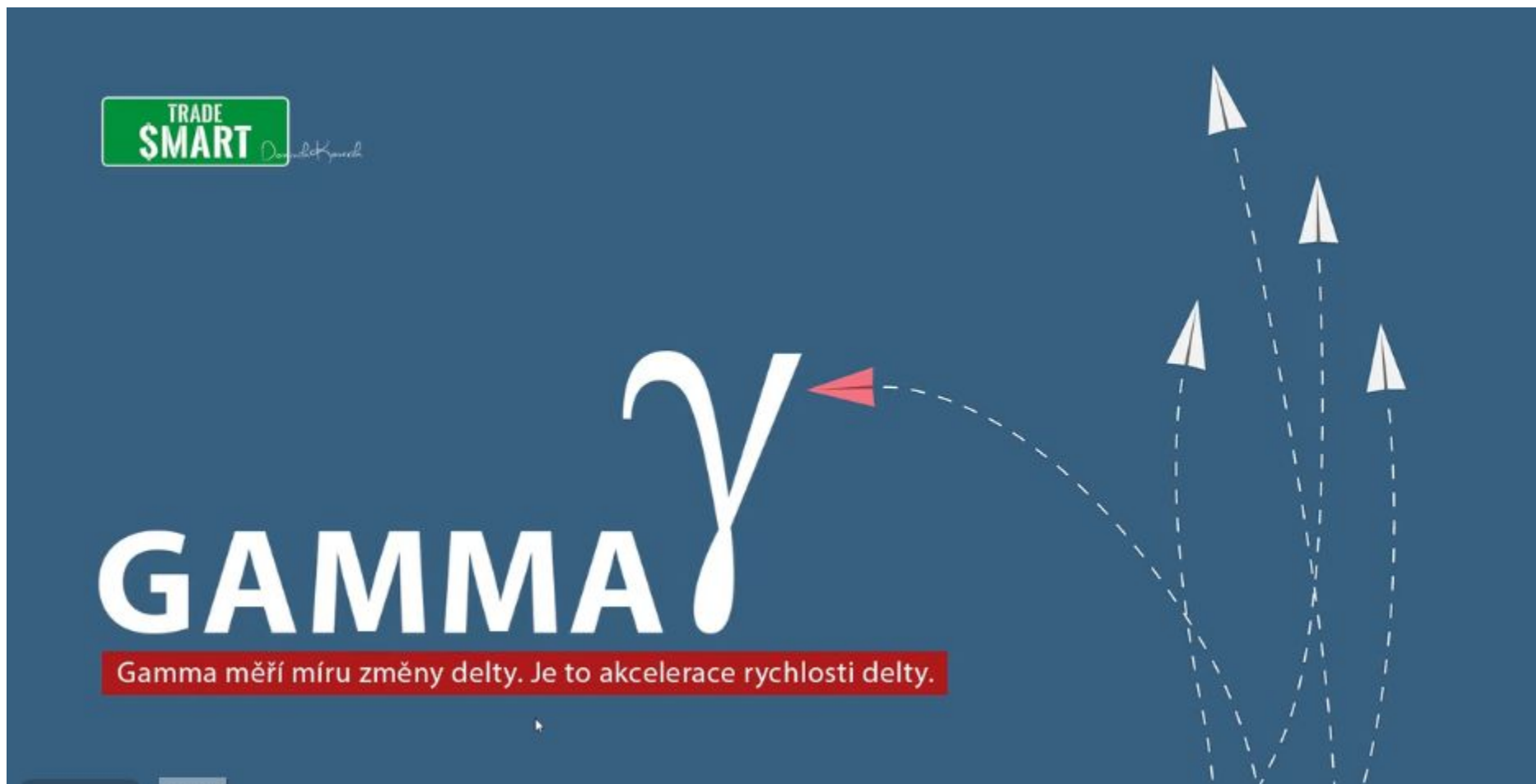
Volume u opcí

Vysoké volume = vysoká likvidita

Snadno půjde vstoupit a vystoupit.

Vyhněte se opcím, kde je nízké volume a široký BID a ASK spread

To, co je u intradenního obchodování s opcemi důležité, je Gamma



Co je to Gamma?

- Gamma měří, jak rychle se změní delta, když se podkladové aktivum pohne o 1 bod
- Gamma je největší u ATM opcí a výrazně se snižuje u opcí ITM a OTM
- Na rozdíl od Delta, Gamma je vždy pozitivní pro call i put opce, ale mění se to, když kupujete nebo vypisujete opce
- Gamma je pozitivní, pokud koupíte call nebo put opci. U call opcí budete mít pozitivní deltu a při put opcí negativní deltu.
- Gamma je negativní, když opce vypíšete. Ať už vypíšete call nebo put opce.
- Gamma se exponenciálně zvyšuje při expiraci a to je to, co vás buď to zachrání nebo zabije

Jaké opce kupuji?

ATM okolo delty 50. Tam, kde je největší Volume a nejvyšší Gamma.

Pojďme se podívat do platformy na rozdíly mezi tím, když koupíme ATM, OTM nebo ITM opce.

Obrovský pozor si dejte na OTM opce. Nikdy nekupovat.

Implikovaná Volatilita

Všeobecně platí, že když opce kupujeme, tak chceme, aby byla IV nízká a rostla.

IV roste, když se trh začne hýbat.

U scalp obchodů toto neřeším.

Pozor si ale dejte, když přijde velký pohyb na akcii a vy budete nahánět trh. Pokud koupíte opce s vysokou IV, tak stačí, aby se pohyb pouze zastavil a pozice začne ztrácet peníze.

Volatilita u akcií

Akcie se nejvíce hýbou po otevření a před uzavřením trhů. (Volatility smajlík)

Pro intradenní obchody potřebujeme, aby se hýbaly, takže obchoduji přesně v tomto období.

V jakém čase přesně obchoduji

15:30 - 16:30 (první hodina po otevření) - nastavte si PRE-MARKET

Scalp setupy a breakouty obchoduji v první půlhodině, často i v prvních 10 minutách po otevření

Cenové patterny poté hledám okolo 16:00 (po první půlhodině) Vstupuji většinou mezi 16:00 - 16:05.

Po 16:30 nezádávám žádné obchody!

Většinou až do 20:00 se pohybují trhy v chopu a nemají tak velké momentum

Poté lze obchodovat close - poslední hodina 21:00 - 22:00

Často se zde objeví setupy a signály s objemy až 15 minut před uzavřením trhů. (21:45)

Seznam akcí

Čím méně akcí budete sledovat, tím lépe.

Obchodujte klidně pouze 1 nebo 2 z tohoto seznamu. Ideálně SPY a AAPL.

Tady je seznam mých oblíbených:

SPY, AAPL, TSLA, SBUX, BA, BYND, UBER, FB, DIS, GOOG, MSFT, QCOM, NFLX, BABA, SHOP, AMD, UAA, ROKU, MU

Scalp vs Intradenní swing

Jak zvýšit úspěšnost tím, že budeme číst zprávy

Vytvořte si watchlist akcií, které sledujete pro intradenní obchody např. u Finance Yahoo.

A před otevřením trhů projděte zprávy pouze na tyto akcie. Většinou tyto zprávy procházím mezi 15:00 - 15:30.

Zajímají mě jen opravdu klíčové informace, které trhem dokážou pohnout a přilákat pozornost investorů.

Toto je klíčové, protože pokud je zde zpráva, tak je tam automaticky objem.

A když je objem, tak se trh hýbe. Pamatujte si, že nic nejede bez plynu.

Jakmile najdu zprávu, tak si otevřu graf a dívám se, jestli je započtena v trhu a akcie otevře gapem. Pak používám setupy pro scalp.

Časové rámce, které používám

Pro scalpy: 1 min

Pro intradenní swing: 5 min. setup a vstup časuji na 1 min.

Před obchodováním vždy analyzuji denní graf a 30 min.
Chci vědět, kde jsou silné úrovně na těchto grafech.

**Postup analýzy. Od vysokého grafu po nízký.
Zakreslujeme silné SR úrovně.
Nezapomeňte i úrovně z pre-marketu.**

Cenové patterny

Po otevření trhů nejdříve hledám patterny na 1 min. grafu

Nejčastěji je to Breakout / Breakdown, 123 a vlajka / trojúhelník

POZOR! Nejde o to pouze najít tento pattern a zadat obchod.

Důležité je, kde se tento pattern nachází na vyšším časovém rámci.

Příklad 123 pattern nad silnou rezistencí na 30 min. grafu.

Vlajka u supportu....

Ideálně chci, aby neměl trh žádné zábrany v cestě na vyšších grafech nebo rezistence a supporty byly co nejdál

Příklady cenových patternů pro scalp a velmi rychlé obchody

Gap and GO, Breakout / Breakdown, 123 a vlajka / trojúhelník

Důležitá je pozice patternu a objemy!

Klíčem je vstoupit a rychle jít pryč.

Pokud vstupuji do longu - nakoupím call opce, tak vystupuji na zelených svíčkách! Nečekám, až trh začne oslabovat.

Gap and Go



Gap and Go



Gap and Go

Chci vidět Gap minimálně nad/pod 30 min. SR

Silnější signál je to při gapu nad/pod denní SR

Ideálně Gap na nový vrchol (Blue Sky), kde není žádná rezistence v cestě.

Je dobré, aby byl Gap podložený důležitou zprávou.

123



min NASDAQ L=297.32 -3.03 -1.01% B=297.31 A=297.40 O=297.15 Hi=300.58 Lo=296.50 V=36,633,878



TA AAPL - 1 min NASDAQ L=297.32 -3.03 -1.01% B=297.31 A=297.40 O=297.15 Hi=300.58 Lo=296.50 V=36,633,878 Mov Avg Exponential (Close,13,0) 297.91



123

Silná svíce na velkém objemu, poté pauza max do $\frac{1}{3}$ předchozí hlavní svíce a vstup je break nad /pod konsolidací.

Stop je možné dát pod/nad pauzovou svíčku nebo pod/nad hlavní silnou svíčku.

klíčové je, kde se tato formace nachází! Nechci, aby v cestě byla SR úroveň. Ideálně chci obchodovat 123 po breaku důležité úrovně z vyššího grafu.

Je dobré, aby byl pohyb podložený důležitou zprávou.

Vlajka / Trojúhelník



Cenové patterny pro intradenní swingy

Tyto patterny hledám na 5 min. grafu, ale vstupy časuji na 1 min. grafu

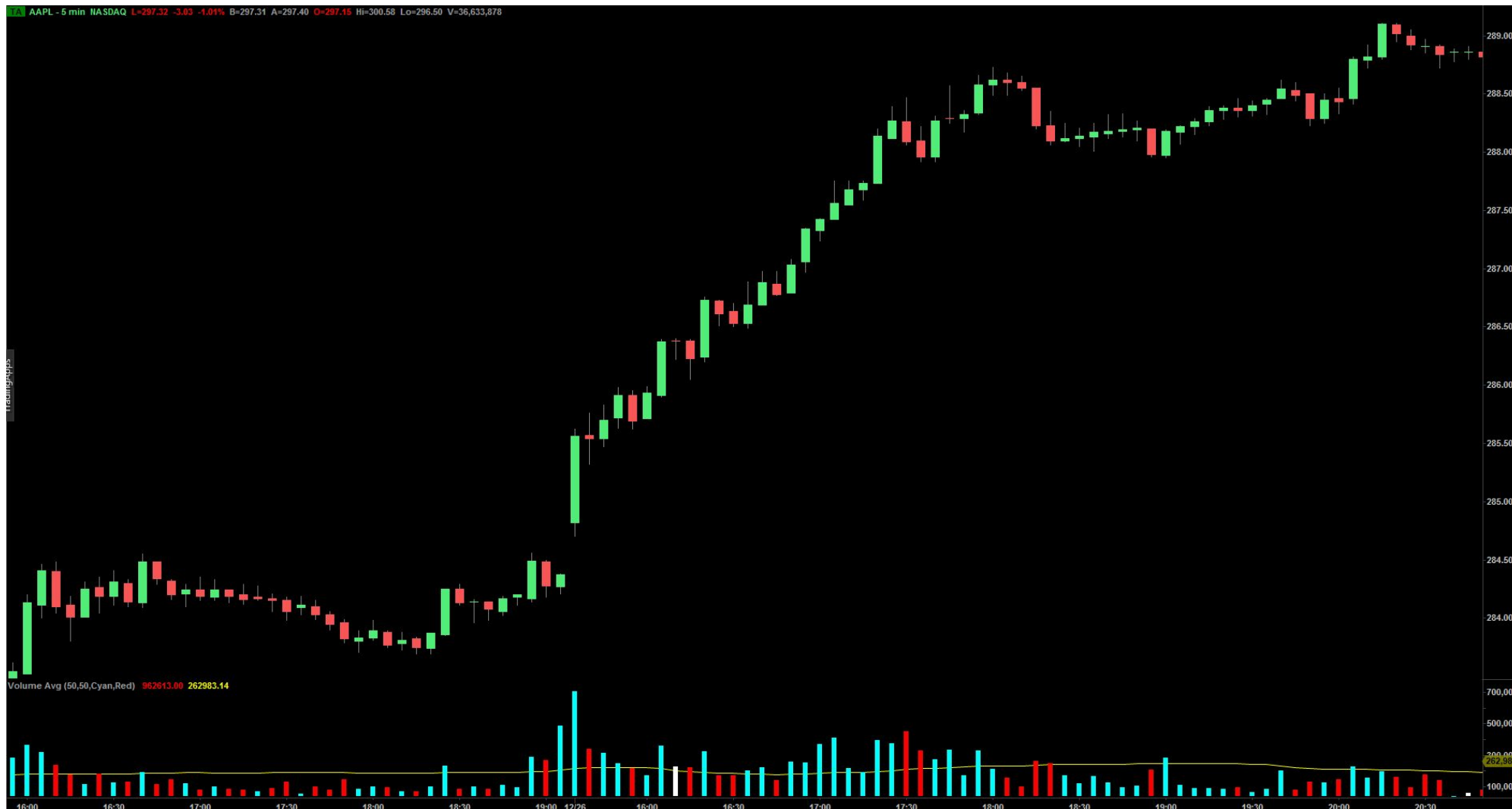
Nejčastěji je to **trojúhelník, odraz od supportu nebo rezistence (reverzní patterny), engulfing, pin bar**

Většinou se tyto patterny začnou objevovat po první půlhodině (okolo 16:00). Nevstupuji před 16:00, nechám, až uzavře svíce na 16:00 a většinou vstupuji mezi 16:01 - 16:10.

V obchodu jsem přibližně 10 - 30 minut. Někdy se trh utrhne a trenduje déle. Pak lze použít trail stopy v podobě posledního supportu nebo předchozí svíce.

Případně lze trailovat stopy dle ATR nebo klouzavého průměru (KP 13 na 1 min. grafu)

Vlajka / Trojúhelník na 5 min.



Reverzní pattern na 5 min.



Reverzní pattern na 5 min.



Pre-earnings intradenní setupy

Před earnings roste na opcích Implikovaná Volatilita.

To znamená, že se opce zdražují, což je obrovský benefit, když opce koupíte a ještě trefíte směr.

A pokud ne, tak to tolik nebolí.

Pokud bude na akcii earnings po zavření trhů (22:00), tak chci ideálně obchodovat ten den, maximálně den před tím.

Nikdy obchod nedržím přes earnings! Vypínám nejpozději 5 minut před uzavřením trhů.

Post-earnings intradenní setupy

Druhý den po earnings Implikovaná Volatilita silně klesne a opce ztratí většinu své hodnoty.

To, co sleduji je, pokud přišel více jak očekávaný pohyb.

Velmi často se stává, že pokud akcie udělá pohyb větší jak 1sd nebo 2 sd, tak pokračuje dál.

Používám zde strategii Gap and GO.

Čekám, než se utvoří první 5 min. svíce, vyznačím se high a low a poté sleduji breaky, které scalpuji.

Internals



Sestavení obchodního plánu a pravidel

Příprava a nastavení platformy pro intradenní obchodování

Psychologie