



最难回答的问题，最错误的期权之路



SAM, PowerUpGammas

**FREE
TUTORIAL**

THE HARDEST QUESTION EVER

WWW.POWERUPGAMMAS.COM | 金融市场观 · 期权 · 定量


如何处理这个“有问题”的头寸



Dear Sam,

Thank you for the email.

最大的挑战:

1. 我只做APPL的期权。当股价变动大时,  现在最近的到期日是 11月17日。Contract 有 1117P180, 1215C180, 0119P185, 0119C185, 0315P180, 0315C160. 在这之前, 我应该做些什么?
2. 如何能做到稳定盈利?

希望能得到你的指导。

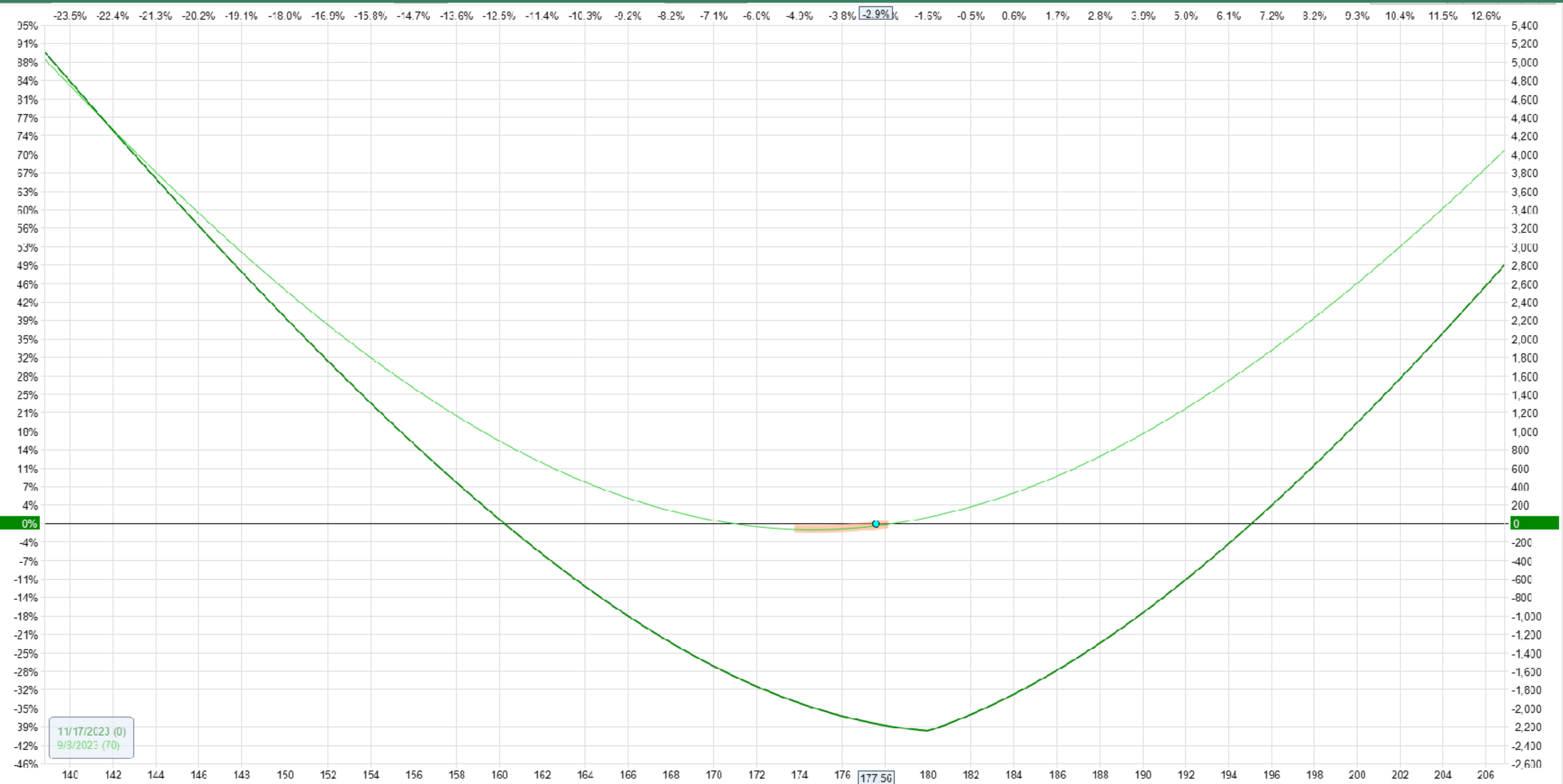
谢谢!

FREE TUTORIAL



THE HARDEST QUESTION EVER

WWW.POWERUPGAMMAS.COM | 金融市场观 · 期权 · 定量



期权是概率游戏

- 从左至右，没有唯一解
 - 交易者谈到是概率，其他人谈的是事情
 - 二项式分布 v.s 股市日回报分布
- **What's your expectation? Focus?**

FREE TUTORIAL



THE HARDEST QUESTION EVER

WWW.POWERUPGAMMAS.COM | 金融市场观·期权·定量

原始邮件

发送时间: 2022年4月22日(星期五) 晚上7:24

我看到你一直在持有ROKU头寸, 如果这个是你的长期头寸, 那么放轻松, 跳到MonthlyChart, 目前我看不到明显的支撑位置。下方一点, 红色区域算一个。但是还有一些距离。从TA角度, 现在的位置属于无人区。价格当前如何流动更接近随机。



FREE TUTORIAL



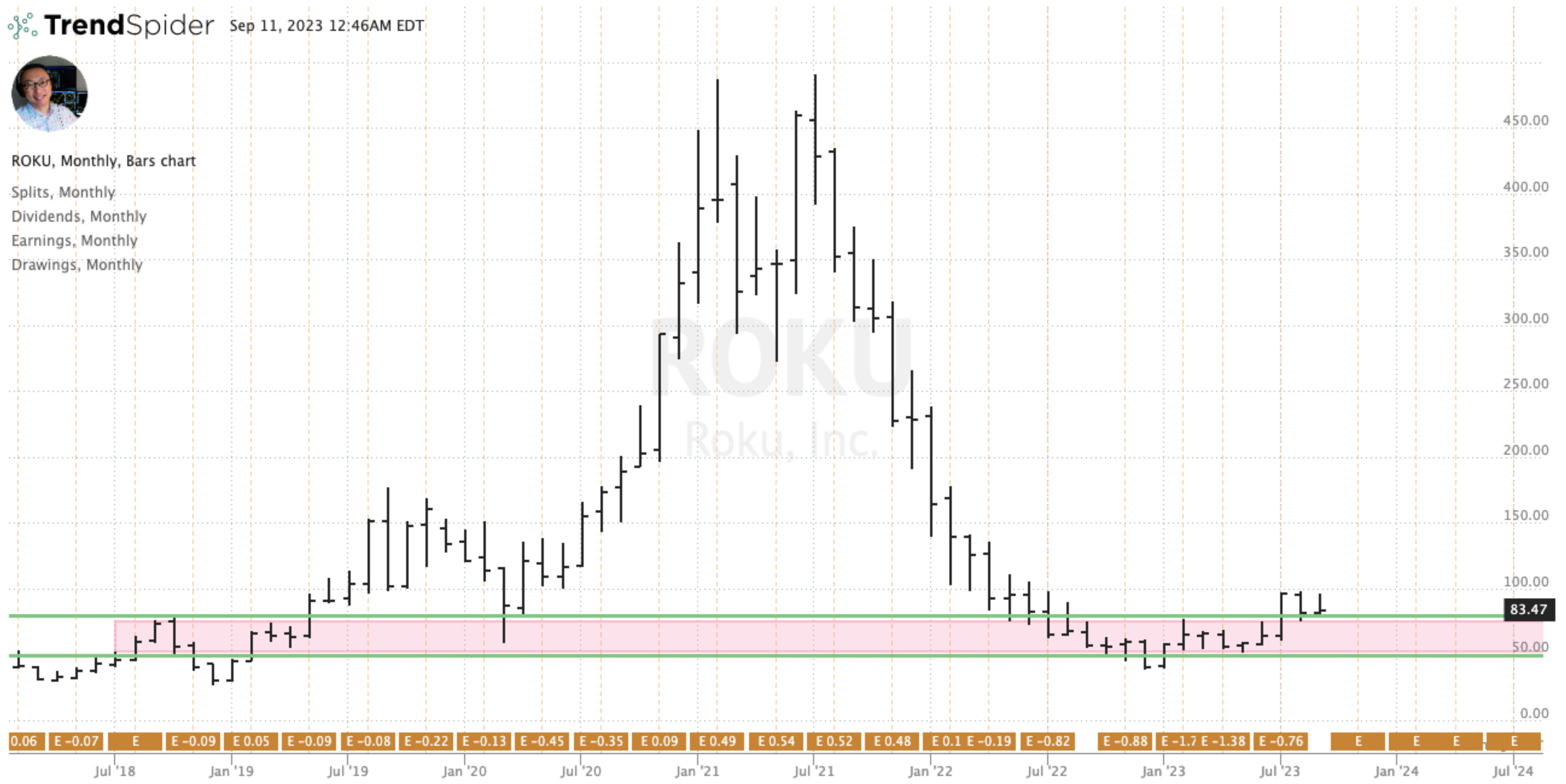
THE HARDEST QUESTION EVER

WWW.POWERUPGAMMAS.COM | 金融市场观·期权·定量

TrendSpider Sep 11, 2023 12:46AM EDT



- ROKU, Monthly, Bars chart
- Splits, Monthly
- Dividends, Monthly
- Earnings, Monthly
- Drawings, Monthly



“Consistent” Winner 伪命题

- 多长是长？夏蝉和冰的故事
- All strategy fails — Facts
- 关注当前持续一致表现，使用概率思维指导行动，寻找新的交易灵感
准备替换当前做法，接受意外情况的发生



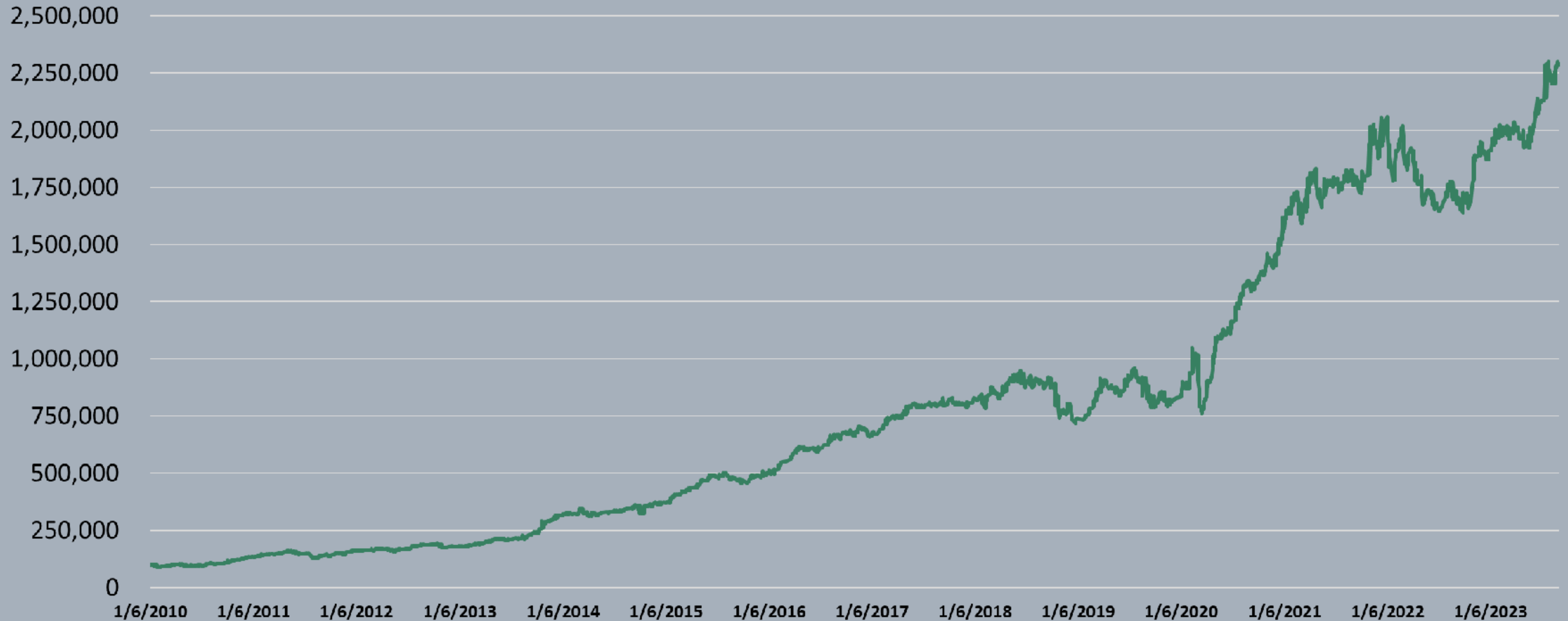
Model Portfolio Equity



Source: PowerUpGammas



Model Portfolio Equity



Source: PowerUpGammas

FREE TUTORIAL



THE HARDEST QUESTION EVER

WWW.POWERUPGAMMAS.COM | 金融市场观 · 期权 · 定量



进入PowerUpGammas School

我们给你的不是一堆结论，而是逻辑；
不仅告诉你表面事实，而是强调背后原理。
你接受的一切信息，将构成你的思维方式；
不成体系的知识，将最终遗忘。

