GERCHIK.RU

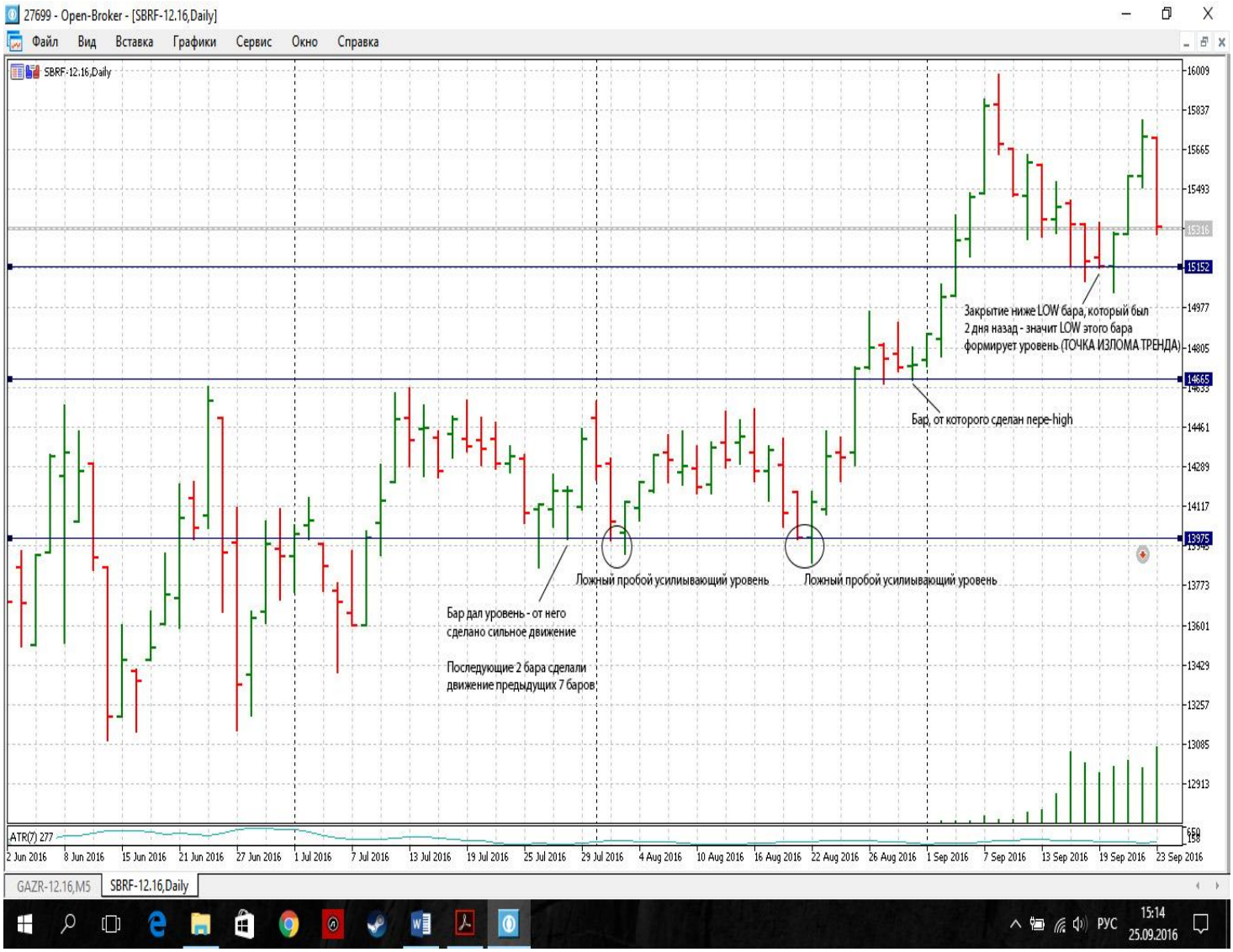
ТОРГОВЫЙ АЛГОРИТМ (FORTS)

Применимость Алгоритма:

Этот алгоритм применим только для торговли рынка FORTS и только для внутридневной торговли. Если захочу торговать среднесрок (от часовиков) – алгоритм следует пересмотреть и переработать.

Содержание:

1. Инструменты. Тайм-менеджмент. Домашка. Дневник трейдера
2. Оформление рабочего стола. Оформление сделок. Идеальная сделка
3. Риск. Статистика. Рост. Управление депозитом
4. Уровни. Гэп. Паттерны. Ложный пробой
5. Тренд. Торговля в тренд. Торговля в контр-тренд. Канал
6. Стоп. ATR. Потенциал
7. Торгуемые модели и правила входа
8. Выход из сделки. Тейк. Выход частями
9. Расчет и вывод прибыли. Ведение календаря



Инструменты. Тайм-менеджмент. Дневник трейдера

Инструменты

Рынок FORTS: Фьючерсы GAZP, SBRF. Период торговли: 5 минут.

Тайм-менеджмент

09:30-10:00 – смотрим рынок, расположение цены относительно дневных уровней.

10:00-11:00 – смотри открытие. Если есть ГЭП, торгуем. Торгуем только пробой и ложный пробой

11:00 – 18:00 – основное время торговли. Торгуются все модели.

18:00 – 23:00 – можно также совершать сделки на FORTS. В это время все сделки за день заносятся в статистику и в дневник трейдера.

Дневник трейдера

Это моя тетрадь, в ней конспект лекций. В дневнике трейдера каждый день должен ставится ответ на вопрос: Зашел бы я в эту сделку еще раз? По каждой сделке нужно написать хоть коротко, хоть нет – но нужно написать.

Оформление рабочего стола. Оформление сделок. Идеальная сделка

Оформление рабочего стола.

Поскольку у меня только один монитор и рабочая платформа MetaTrader 5, то рабочий стол должен содержать: 2 графика (дневка и 5-ти минутка) + балансовое окно + символы. Пример:

Оформление сделок.

Поскольку я торгую 5-ти минутки, то времени вписывать электронно сделку может не быть. Поэтому, на листке, ручкой пишу ответы на контрольные вопросы:

А) ATR

Б) Текущий ATR

В) Остаток ATR – для входа в сделку у меня должен быть минимальный запас около 60% ATR. Если остаток около 30% или ниже, то в тренд не торгую! Смотрю контр-тренд.

Г) Смотрю тренд по дневке

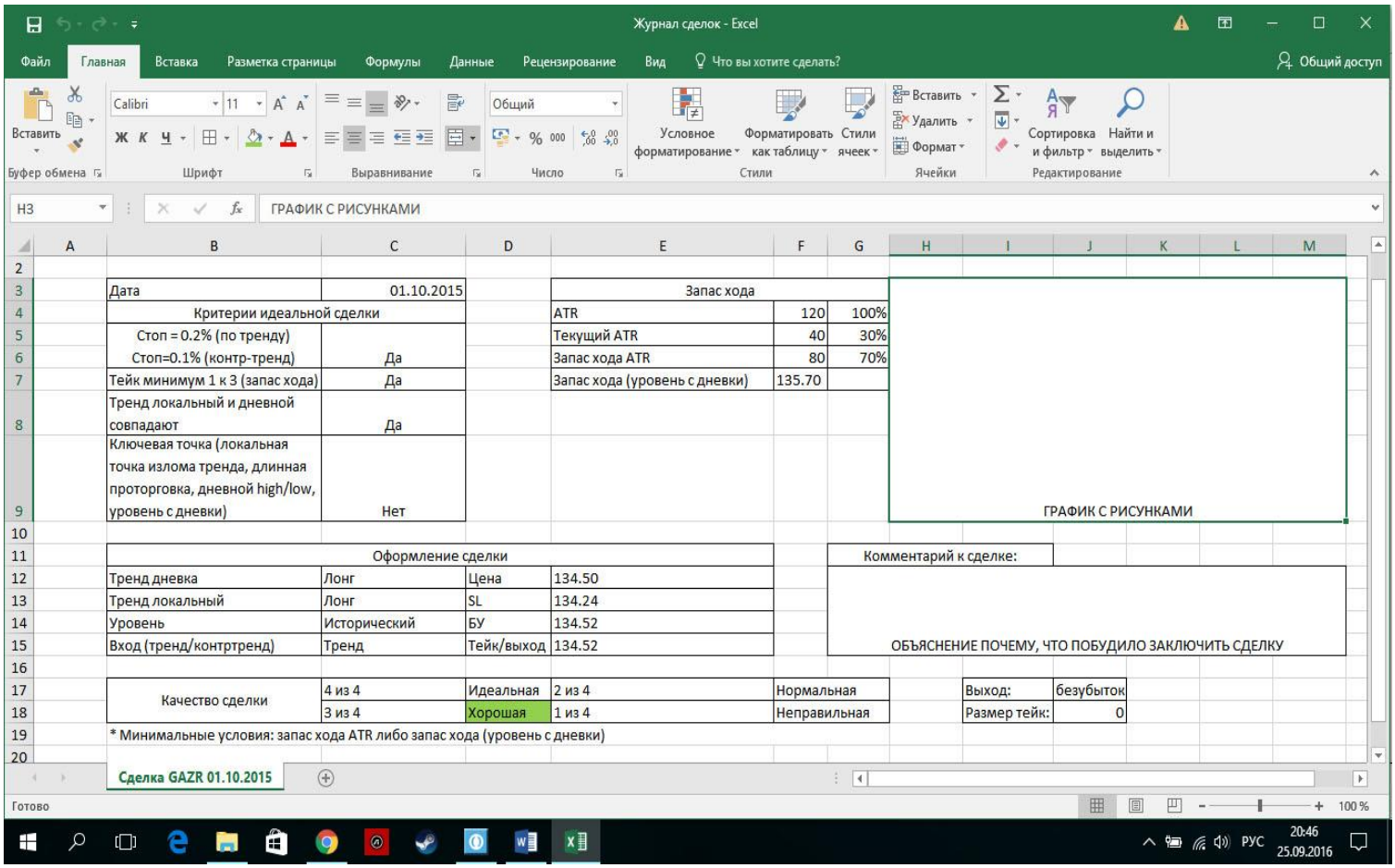
Д) Смотрю локальный тренд

Е) Проверяю уровень на его силу – сила будет указана в пункте «Уровни»

Ж) Определяю потенциал – минимум 1/3 от точки входа

Если убеждаюсь, что сделка соответствует этому алгоритму: соблюдены условия совершения сделки (ATR, направление, потенциал, графическая модель, размер стопа, точка входа, точка выхода) – совершаю сделку.

Вечером, каждая совершенная сделка вписывается в «Журнал сделок». Журнал сделок – это файл excel. В него ежедневно вписываются совершенные сделки. Один файл – одна рабочая неделя. Так выглядит запись сделок (цифры для примера):



Дата	01.10.2015		Запас хода			
Критерии идеальной сделки			ATR	120	100%	
Стоп = 0.2% (по тренду)			Текущий ATR	40	30%	
Стоп=0.1% (контр-тренд)	Да		Запас хода ATR	80	70%	
Тейк минимум 1 к 3 (запас хода)	Да		Запас хода (уровень с дневки)	135.70		
Тренд локальный и дневной совпадают	Да					
Ключевая точка (локальная точка излома тренда, длинная проторговка, дневной high/low, уровень с дневки)	Нет					
Оформление сделки						
Тренд дневка	Лонг	Цена	134.50			
Тренд локальный	Лонг	SL	134.24			
Уровень	Исторический	БУ	134.52			
Вход (тренд/контртренд)	Тренд	Тейк/выход	134.52			
Качество сделки	4 из 4	Идеальная	2 из 4	Нормальная		
	3 из 4	Хорошая	1 из 4	Неправильная		

ГРАФИК С РИСУНКАМИ

Комментарий к сделке:

ОБЪЯСНЕНИЕ ПОЧЕМУ, ЧТО ПОБУДИЛО ЗАКЛЮЧИТЬ СДЕЛКУ

Выход: безубыток

Размер тейк: 0

* Минимальные условия: запас хода ATR либо запас хода (уровень с дневки)

Идеальная сделка

Мои критерии идеальной сделки:

1. Тренд акции глобальный и локальный совпадают
2. Торговля ведется возле сильного уровня
3. Потенциал в сделке – запас хода
4. Риск в сделке – не более 0.2% от цены инструмента
5. Соотношение риск/прибыль не меньше 1 к 3

Пока что, я не понимаю, что означают новости и нефть. Для меня это сейчас лишняя информация.

Риск. Статистика. Рост. Управление депозитом

Риск

Риск на день торговли – 1% депозита

Риск на сделку – 0.2% от цены инструмента по тренду.

Риск на сделку – 0.1% от цены инструмента по контр-тренду.

Любая сделка – не более 0.2% от депозита (для случаев, когда очень низкая волатильность и можно ставить совсем маленький стоп).

Статистика

Каждый торговый день статистика выгружается из личного кабинета в сервис marketstat. Анализ статистики проводится 1 раз в 3 месяца.

Рост

Первая неделя: 1 контракт на 2 инструментах. Если первая неделя в +, то

Вторая неделя: 2 контракта на 2 инструментах. Если вторая неделя в +, то

Третья неделя: 3 контракта на 2 инструментах.

Если вторая неделя в -, то

Третья неделя: 1 контракт на 2 инструментах.

Таким образом, правило: если неделя в «+», то добавляем контракт; если неделя в -, то убираем контракт. Лесенка получается.

По достижению 10 контрактов – добавляю 2 контракта и убираю 2 соответственно.

По достижению 30 контрактов – работаю с 3 контрактами.

По этой же логике: переходные точки 50, 70, 100 контрактов.

ВНИМАНИЕ – УСЛОВИЕ ТАКОГО РОСТА: Депозит должен позволять заходить в сделку. Если при более высоком количестве контрактов депозит не позволяет сохранять риск на сделку в пределах 0.2%, то переход не осуществляется.

Управление депозитом

Поскольку трейдинг это не мой основной источник заработка, то я могу пополнять депозит систематически с других источников дохода. 20% своего заработка я откладываю для инвестирования, эти деньги буду пополнять депозит вплоть до значения 1 000 000 рублей.

Заработок от трейдинга непосредственно не будет оставаться на счете, а будет выводится. ***Я здесь, чтоб зарабатывать деньги, а не заниматься ментальной мастурбацией.***

Уровни. Гэп

Уровни

Уровень образуется от ключевых точек. Уровень – это цена, которая несет информативность; цена – вокруг которой или от которой происходит сильное движение.

Ключевая точка – любая точка, которая несет за собой информативность. Ключевая точка бывает 3 видов:

А) Точка излома тренда – самая сильная ключевая точка. Это разворот, изменение направления движения.

Б) Проторговка над или под уровнем. Проторговка (от 3 баров) – это невозможность инструмента пробить определенную цену. Проторговка говорит о наличии лимитного игрока, при этом такой покупатель/продавец работает с одной (фиксированной) ценой. Расхождение допускает от 1 до 5-7 пунктов, в зависимости от величины ТФ.

В) Длинный хвосты или тела. Бары с ходом больше 2 ATR. Длинный хвосты – свидетельствуют, что кто-то собирает стопы.

Пример:

Уровни бывают двух видов:

А) Плавающие – ситуация, когда на графике происходит торговля вокруг какой-то цену. Цену при этом определить невозможно.

Б) Четкие – ситуация, когда high/low нескольких свеч касается одной, определенной цены.

После плавающего уровня следует ждать консолидацию и проторговку, то есть перехода из плавающего в четкий.

Уровни проводятся СЛЕВА НАПРАВО.

Уровни ОТРАБАТЫВАЮТ СПРАВА НАЛЕВО, то есть сначала ближайшие.

Сила уровня определяется количеством касаний, чем больше касаний, тем сильнее уровень. Трендовый уровень сильнее контртрендового.

Распределение уровней по силе от слабого к сильному:

i) Воздушный уровень – уровень раньше не встречался (минимум 3 бара).
ii) Воздушный уровень + круглая цифра – уровень, который раньше не встречался формируется на круглой цифре (25, 50, 75, 100).
iii) Исторический уровень – уровень, который встречался раньше
iv) Исторический уровень + круглая цифра – уровень, который встречался раньше на круглой цифре.
v) Зеркальный уровень – уровень, который раньше был уровнем поддержки стал уровнем сопротивления и наоборот.
vi) Зеркальный уровень на круглой цифре.

Пример:

Гэп

Границы гэпа образуют также сильные уровни поддержки и сопротивления.

Паттерны

Паттерн – это графическая модель, состоящая из нескольких баров и дающая определенное, вероятностное ожидание относительно будущего движения цены. Основные паттерны:

Аккамуляция – маленькие бары идут друг за другом. Открытие каждого последующего бара идет в гэпом в обратную сторону движения. Этот гэп перекрывает и бар делает перehigh.

Дистрибьюция – 2-3 больших бара подряд. Бары открываются с гэпом в сторону движения. Как правило это конец движения.

Длинный бар, который бьет в уровень – это как правило разворот.

Бар без хвостов (закрытие в high/low) – важный знак для дневного бара. Означает, что игрок не собрал позицию. Вероятно, следующий день будет в том же направлении.

Треугольник – пробойная модель

Треугольник с ложными пробоями – пробойная модель

Треугольник + выравнивающий, либо перекрывающий бар – разворотная модель.

Медвежье поглощение – бар, охватывающий минимум 2 предыдущих бара сверху вниз. Закрытие должно быть ниже low 2-го бара. Сильный шортовый сигнал.

Бычье поглощение – бар, полностью охватывающий минимум 2 предыдущих бара снизу вверх. Закрытие должно быть выше high 2-го бара. Сильный лонговый сигнал.

Хвосты вверх – такую формацию следует искать возле уровня сопротивления. Это сильный шортовый сигнал.

Хвосты вниз – такую формацию следует искать возле уровня поддержки. Это сильный лонговый сигнал.

Хвосты в обе стороны – разворотная модель. Цена пойдет туда, откуда пришла.

Маленькие бары в сторону уровня – пробойная модель.

Консолидация после движения – это модель продолжения тренда. Ее нельзя торговать в обратную сторону.

Ложный пробой

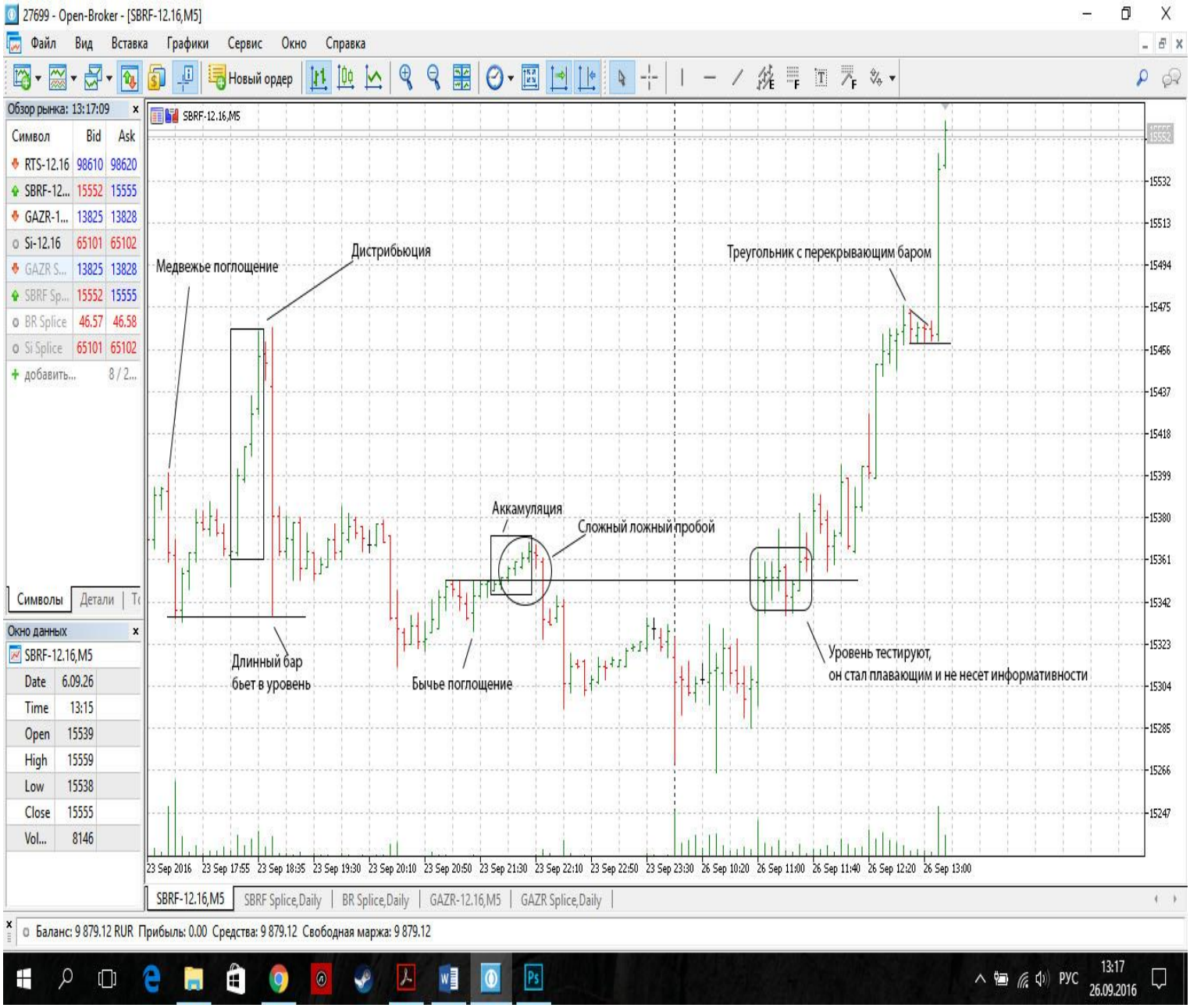
Ложный пробой – это невозможность эмитента переписать high или low. Ложный пробой образуется только относительно уровня. Любой ложный пробой усиливает уровень – поскольку ложный пробой - это инструмент крупного игрока набрать позицию.

Ложный пробой бывает двух видов: простой и сложный.

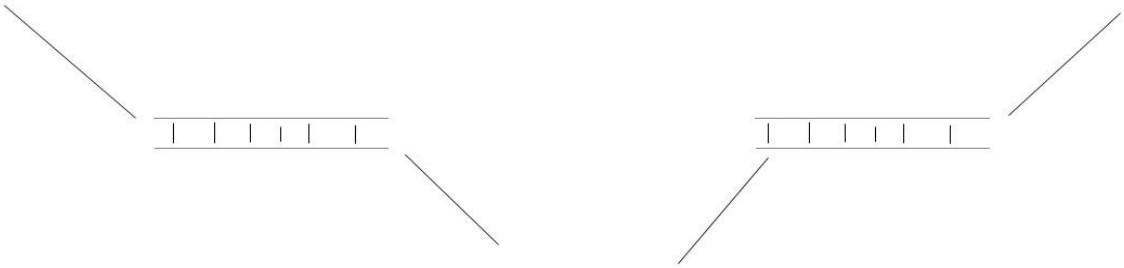
Простой ложный пробой образуется 1-им баром. Это сбор стопов.

Сложный ложный пробой (2 и более баров) затягивает и продавцов, и покупателей. Сложный ложный пробой сильнее простого.

Примеры паттернов и ложных пробоев:



Консолидация после движения (картинка):



Примечание по паттернам: преимущественно, их целесообразно использовать на дневном графике, поскольку сам паттерн не дает нам возможность рассчитать стоп и точку входа. Только в комбинации с уровнями от них есть толк.

На маленьких таймфреймах: паттерн - это ориентир, не более. Он не может служить основанием принятия решения о заключении сделки. Он просто усиливает сигнал, но сам им не является (кроме треугольников – они строятся на уровне).

Тренд. Торговля в тренд. Торговля в контр-тренд. Канал

Тренд

Тренд – это определенное направление цены. Тренд бывает двух видов:

А) Глобальный – нахождение цены на дневном графике относительно уровней поддержки и сопротивления. «Выше полосочки покупаем, ниже полосочки продаем».

Б) Локальный – используется для торговли внутри дня.

ПРАВИЛО: Один бар тренд не ломает.

Определение локального тренда:

А) Открытие без гэпа. Если текущая цена (ТЦ) меньше цены закрытия предыдущего дневного бара (ЦЗ) локальны тренд – шорт. Если ТЦ больше ЦЗ локальный тренд – лонг.

Б) Окрытие с гэпом. Если цена открытия (ЦО) больше ТЦ локальный тренд – шорт. Если ЦО меньше ТЦ – локальный тренд лонг.

Торговля в тренд

При торговле в тренд используются все модели в их текущем виде. Стоп на сделку составляет 0.2% от цены.

Торговля контр-тренд

Торговля контр-тренд относится именно к локальному тренду. Это торговля против локального тренда.

Осуществляется она только после прохождения ATR 70% дневного движения. Стоп для контр-трендовой сделки = 0.1% от цены.

В контр-тренд торгую только ложные пробои.

Канал

В канале разрешена торговля, если ширина канала равна или больше 6 стопов. Если мы в середине канала, то торговля разрешена, если в сторону торговли есть 4 и больше стопов.

У верхней границы канала лучше не покупать.

У нижней границы канала лучше не продавать.

Стоп. ATR. Потенциал

Стоп

Стоп – допустимый убыток на сделку. Максимальный размер стопа составляет 0.2% на 1 сделку.

Риск на один день равен 1%.

ATR

Average True Range – среднестатистическое движение инструмента за единицу времени. ATR берется с дневки. Он равен разнице между high low среднестатистического бара.

ВАЖНО: ATR учитывается только при прохождении цены в одном направлении. Прохождение ATR надо считать от цены закрытия предыдущего дня. Таким образом ГЭП уже включается в ATR.

ATR нам дает запас хода в сделке по тренду, поскольку, при прохождении эмитентом в одном направлении всего ATR, существует 80% вероятность, что эмитент пойдет в обратном направлении. ATR это как пружина.

Потенциал

Потенциал определяется двумя способами:

А) Технический – от уровня к уровню. Расчет идет именно по ключевым дневным уровням. Запас хода должен быть минимум 1 к 3 до дневного уровня (размер стопа от точки входа)

Б) Запас хода ATR. Запас хода должен быть не меньше 40%.

Если Технический запас хода есть, но ATR не позволяет войти в сделку – торгую контр-тренд.

Торгуемые модели и правила входа

Пока отсутствует статистика – я торгую 3 модели:

Модель А – отбой от уровня.

Модель Б – простой ложный пробой.

Модель В – сложный ложный пробой.

Модель Г – пробой.

Модель А. Отбой от уровня.

Торгуется только в направлении локального тренда.

Модель состоит из 4 баров – БСУ, БПУ1, БПУ2 и ТВХ.

Если 4 бара идут подряд – это воздушный уровень, если между БСУ и БПУ1 есть другие бары, а БСУ и БПУ1 бьют одной стороной в цену – это исторический уровень. Если между БСУ и БПУ1 есть другие бары, а БСУ и БПУ1 бью в цену с разных сторон (пример: БСУ high,

а БПУ1 low) – то это зеркальный уровень. БСУ и БПУ1 должны бить точно в одну цену, ни пункта разницы.

Между БСУ и БПУ1 может быть сколько угодно баров. Между БПУ1, БПУ2, ТВХ не может быть других баров и БПУ1, БПУ2, ТВХ не должны прошивать уровень ни на пункт.

БПУ2 и ТВХ могут не добивать в уровень на размер люфта.

За 30 секунд до конца формирования БПУ2 выставляется лимитный ордер с учетом люфта от уровня. Следом выставляется стоп-ордер (либо одновременно, если позволяет платформа).

Люфт равен 20% от размера стопа и позволяет дать рынку лучшую цену, чтобы войти в сделку. Таким образом при торговле лонг – люфт прибавляется к цене уровня; при торговле шорт люфт отнимается от цены уровня.

Лимитный ордер отменяется, если мы не получили сделку и цена ушла в сторону движения на размер 2 стопов. Также, если образовался ложный пробой, то модель должна сформироваться снова – БПУ1 ударить в цену, БПУ2 может не добить на размер люфта и ТВХ.

Если выбило по стопу – повторный заход разрешается, если модель сформировалась снова.

Пример с графика:

Модель Б - Простой ложный пробой

Простой ложный пробой образуется одним баром. Это бар, который прошивает уровень и возвращается обратно.

Я торгую простой ложный только возле сильных ключевых уровней – это уровни с дневки. Внутридневные уровни не торгую простым ложным пробоем. Мы берем следующие уровни: точки high/low, точки излома тренда, экстремы.

Дневной уровень разрешено торговать простым ложным пробоем на 5-ти минутном таймфрейме.

По времени: ложный пробой не торгуется с 10:00-11:00 и с 18:00-19:00

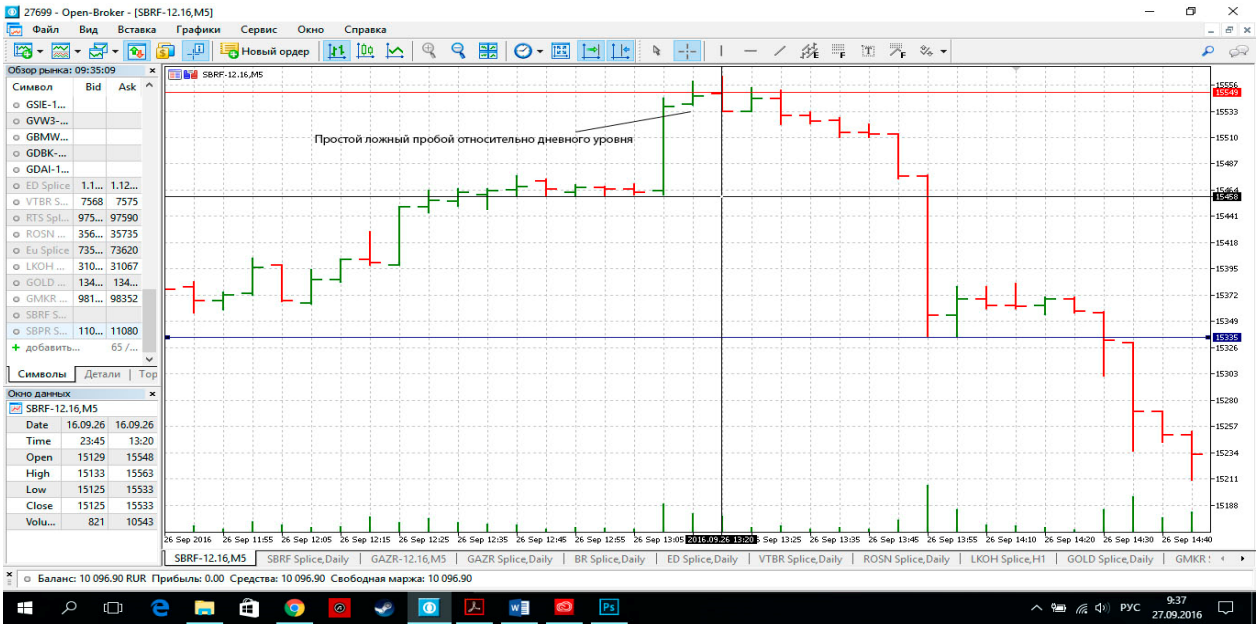
Правило совершения сделки с ложным пробоем:

1. Определяем ключевой уровень на дневке
2. Видим пробитие этого уровня
3. После пробития сразу стоп ордер за уровень
4. Стоп ставится сразу за уровень – я буду ставить 10 пунктов цены.
5. Тейк: а) если подход был на больших барах, то ставлю 75% отката до предыдущего технического уровня (минимум 1 к 3); б) если подход был не на больших барах – беру 1 к 3.
6. При прохождении 2 стопов – позиция переносится в безубыток.

Если вынесло по стопу – то разрешается повторный заход на следующем баре, который также должен сделать ложный пробой.

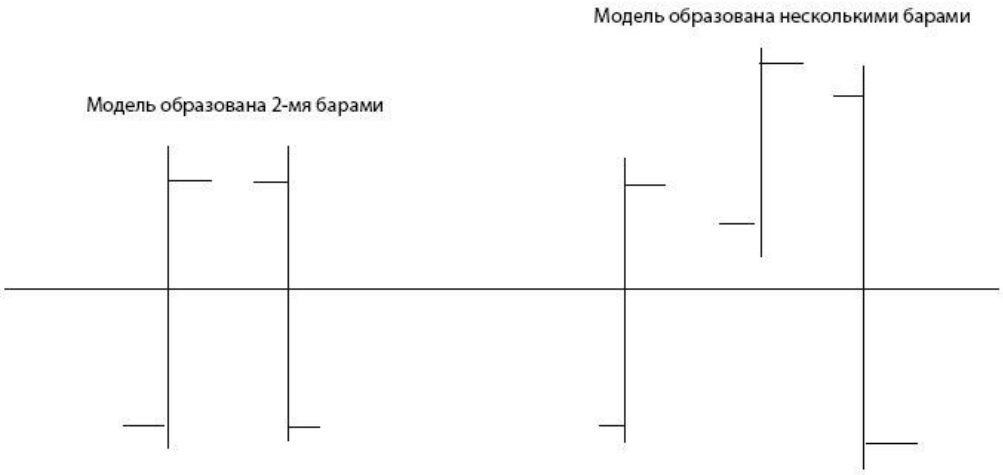
Еще наблюдение: после ложного пробоя должен быть импульс, но не всегда. Желательно, чтобы он был. Если импульса нет – то выход все равно по стопу.

Пример:



Модель В. Сложный ложный пробой

Все правила, как и для простого ложного пробоя, но сложный образуется двумя или несколькими барами. Схема:



Сложный ложный пробой можно торговать относительно сильных уровней, в том числе внутридневных. Я буду торговать как модель из 2-ух баров, так и из нескольких. Чтобы торговать модель из нескольких баров – уровень должен быть очень сильным, желательно быть с дневки (high/low, экстремы, точки излома тренда).

Условия совершения сделки:

1. Сильный уровень
2. Бар пробивает и закрывается за уровнем
3. Выставляется стоп ордер сразу за уровнем
4. Стоп ставится также короткий – 10 пунктов

Модель Г. Пробой

Пробой – это импульсная модель. Торгуется стоп ордером и с коротким стопом. Я эту модель плохо понимаю, но есть усиливающие паттерны: треугольник и треугольник с ложными пробоями. На этих паттернах буду торговать пробой.

Также, если после ложного пробоя не происходит перехай или перелоу, то возможно будет пробой.

Пробой лучше торговать после сильной консолидации.

Если после пробоя не происходит резкого, импульсного движения – валю рыночным ордером.

Если происходит прошивание уровня, но после ложного пробоя крайняя точка (технически стоп) не отдаляется, а приближается – это пробойная модель, поскольку стопы не задеваются и кто-то набирает позу.

Выход из сделки. Тейк. Выход частями

Выход из сделки

Выход из сделки осуществляется по фиксированному тейку 1 к 3, если размер сделки составляет 1 контракт.

Выход частями

Выход частями можно производит и с помощью отношения к стопу (не менее 1 к 3) и технически, при образовании разворотного сигнала или приближения к ключевому уровню.
Пример: 1 контракт закрыл 1 к 3, 2-ой контракт 1 к 5.

Данные правила можно пересмотреть, когда научусь не сливать депозит.

Расчет и вывод прибыли. Ведение календаря

Прибыль выводится раз в 2 недели.

Календарь веду каждый день – он ведется в пунктах. Веду его в электронном виде.