

Рекомендуемая литература

1. Внутрдневная торговая система: 5 баллов за успех! /НП «Форекс Клуб». – М.: Форекс Клуб , 2003 – (Школа валютных трейдеров).
2. Индикатор Ишимоку как основа торговой системы / НП «Форекс Клуб». – М.: Форекс Клуб , 2004 – (Школа валютных трейдеров).
3. Торговая система трейдера: фактор успеха /НП «Форекс Клуб». – М.: Форекс Клуб, 2003 – (Школа валютных трейдеров)
4. Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги / НП «Форекс Клуб». – М.: Форекс Клуб, 2004 – (Школа валютных трейдеров).
5. Фундаментальный анализ финансовых рынков /НП «Форекс Клуб». – М.: Форекс Клуб, 2003 – (Школа валютных трейдеров).
6. **Винс Ральф** «Математика управления капиталом. Методы анализа риска для трейдеров и портфельных менеджеров».
7. **Винс Ральф** «Новый подход к управлению капиталом. Структура распределения активов между различными инвестиционными инструментами».
8. **Джонс Райан** «Биржевая игра. Сделай миллионы – играя числами». – М.: ИК «Аналитика», 2001.
9. **Колби Р.В., Мейерс Т.А.** «Энциклопедия технических индикаторов рынка». – М: Издательский дом «АЛЬПИНА», 1998.
10. **ЛеБо Ч., Лукас Д.В.** «Компьютерный анализ фьючерсных рынков». Пер. с англ. – М.: Издательский дом «АЛЬПИНА», 1998.
11. **Мэрфи Дж. Джон** «Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика» - Издательство «Сокол», 1996.
12. **Нисон Стив.** «Японские свечи: графический анализ финансовых рынков». Перевод с англ. Дозорова Т., Волкова М.А. – Издательство «Диagramма», 1998.
13. **Нисон Стив.** «За гранью японских свечей». Перевод с англ. Волкова М.А., Волков А.А. – Издательство «Диagramма», 2001.
14. **Найман Э.-Л.** «Малая энциклопедия трейдера». – ВИРА-Р Альфа Капитал, 1999.
15. **Пискулов Д.Ю.** «Теория и практика валютного дилинга». – Фирма «Финансист», 1996.
16. **Пискулов Д.Ю.** «Настольная книга валютного дилера» – СП "Крокус Интернэшнл", 1992.
17. **Пискулов Д.Ю.** «Валютный рынок и валютное регулирование». - Учебное пособие /Под ред. И.Н.Платоновой. - Издательство «БЕК», 1996.
18. **Сорос Дж.** «Алхимия финансов». - М.: Инфра-М, 1996.
19. **Суворов С.Г.** «Азбука валютного дилинга».— СПб.: Издательство С.-Петербургского университета, 1998.
20. **Твид Ларе** «Психология финансов». – М.: ИК «Аналитика» 2002.
21. **Швагер Джек** «Технический анализ. Полный курс». – М.: Альпина Паблишер, 2001.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

22. Элдер А. «Практическое пособие дилеру биржевых и внебиржевых рынков. (Психология, технический анализ рынка, управление деньгами, менеджмент риска, стратегия и тактика биржевой игры)». - М.: АЗИМУТ ПЛЮС, 1995.

23. Эрлих А.А. «Технический анализ товарных и финансовых рынков: Прикладное пособие». - 2-е изд. - М.: ИНФРА-М, 1996.

1 часть - Нюансы работы по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 08.08.2006

! ВАЖНО !

Обращаем Ваше особое внимание на то, что использование нижеприведённых методов работы НЕ означает, что ТС «Консервативный скальпинг intraday» представляет собой незаконченную ("сырую") версию торговой стратегии, которую, при желании, можно дополнять различными правилами и методиками торговли.

Автор настоятельно рекомендует отдавать приоритет базовым (основным) сигналам, которые подробно разобраны в книге «Консервативный скальпинг intraday». При этом работа с помощью метода открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона целесообразна только в случае принятия трейдером чёткого решения (в том числе и взятия повышенных рисков) об отказе торговли по базовым правилам из-за возможности извлечь наибольшую выгоду ввиду сложившейся нестандартной ситуации на рынке.

Нюансы работы по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

Типы нестандартных участков рынка. Нестандартный участок №1.

В книге, посвящённой изучению торговой системы «Консервативный скальпинг intraday» мы с вами подробно исследовали общие принципы и методику работы внутри дня по заранее составленному алгоритму (правилам) в условиях идентификации одного из трёх участков рынка, а также отслеживании сигналов на покупку/продажу, подаваемых осцилляторами Stochastics и MACD.

В цикле статей, посвящённой данной проблеме будут рассмотрены некоторые новые нюансы работы по приведённой в книге методике, с целью максимально полно и подробно разобрать:

- нестандартные участки рынка, не попавшие в общую классификацию;
- методы работы на нестандартных участках при помощи дополнительных (вспомогательных) инструментов;
- идентификацию отбойных сигналов от скользящих средних;
- методику работы при открытии позиции, подаваемые осцилляторами на этих участках, а также её последующего сопровождения.

Первое с чего хочется начать, это с общего исследования нестандартных участков рынка, часто встречающихся при ежедневной работе с торговой системой «Консервативный скальпинг intraday», которые не всегда удаётся выделить в соответствии с общей классификацией, приведённой в книге. Одним из таких участков («Нестандартный участок №1») является консолидация цены (для GBP, EUR, CHF) в достаточно узком диапазоне (менее 40–60 пунктов) в течение европейской сессии (до 12-00GMT-14-00GMT – обычно перед выходом блока экономических данных по США).

Популярные методы работы на данных участках, такие как «метод расширения торгового диапазона» или «торговля на изменении волатильности» с переменным успехом используют подобные закономерности. В цикле статей мы попытаемся проанализировать возможность открытия позиции и отсеечения сигналов, дающих ложные входы при использовании вышеуказанных методов на основе базовых правил торговой системы «Консервативный скальпинг intraday».

Начнём с самого простого метода – «метод открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона». В качестве примера возьмём график GBP за 01.08.2006, представленный на рис. 1.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй



Рис. 1. GBP. Флотовый участок. Работа на нестандартном участке при помощи вспомогательных инструментов (дополнительный канал).

На данном графике отчетливо виден узкий канал, шириной менее 60 пунктов. При этом с 06-00GMT касания ни верхней, ни нижней границы конверта из 34EMA не наблюдается и открытие позиции согласно правилам работы на флетовом участке рынка не представляется возможным. В этом случае можно воздержаться от открытия позиции, а можно попробовать спрогнозировать дальнейшее поведение цены с использованием некоторых вспомогательных инструментов. Одним из таких вспомогательных инструментов может являться обычный стандартный канал. С помощью программы технического анализа Rumus 2 построим данный **дополнительный канал** имеющий ширину 56 пунктов от Low **1,8625** (свеча за 05-10GMT) – точка №1 и High **1,8681** (свеча за 08-40GMT) – точка №2.

После того как цена сформировала на верхней стороне канала точку №3 (новый дневной максимум) – High **1,8686** (свеча за 12-40GMT), и отскочила к нижней стороне, при этом, не дойдя до дневного минимума, сформировала точку №4 – (Low **1,8632** (свеча за 12-50GMT)). Последняя точка подтвердила ранее построенный канал, и мы принимаем решение о работе «на пробой» нижней или верхней сторон дополнительного канала.

Для этого установим ордера на покупку на 10 пунктов (5 пунктов спрэд + 5 пунктов пробой, а для большей точности (надёжности) определения пробоя уровня следует брать 7-10 пунктов + 5 пунктов спрэд) выше последнего дневного максимума (точка №3) – **1,8696**. Также устанавливаем ордер на продажу на 5-7 пунктов ниже последнего дневного минимума (точка №4) – **1,8632**. При этом ордера Stop-Loss устанавливаются стандартным для GBP, равным 40 пунктам, а ордер Take-Profit согласно рекомендуемому коэффициенту нормальной доходности $K_d = 1,5 - 2,0$ в размере 60 – 80 пунктов (в данном примере установим Take-Profit в размере 80 пунктов).

Дальнейшее развитие событий полностью подтвердило выбранный нами план работы на данном участке рынка. После того как в 15-20GMT цена пробила верхнюю границу канала и была открыта позиция по цене **1,8696** (точка №5), были автоматически (ордер If Done) выставлены ордера Stop-Loss на уровне **1,8656** и Take-Profit на уровне **1,8776**. Так как до конца дня ни один из выставленных ордеров не сработал, то согласно правилу принудительного закрытия позиций в 20-00GMT по цене **1,8758** была зафиксирована прибыль в размере **+62** пункта.

В качестве самостоятельной проработки данного способа открытия и ведения позиции на данном примере советую рассмотреть варианты с использованием целей частичного закрытия позиции и добавления

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

к позиции при помощи методики Pivot Points. В качестве закрепления изученного материала советую рассмотреть возможность и способы работы на схожем участке рынка за 14.03.2006 (валютная пара GBP/USD).

В следующей статье речь пойдёт о втором типе нестандартных участков рынка, встречающихся при ежедневной работе с торговой системой «Консервативный скальпинг intraday», а именно об участках консолидации цены (для GBP, EUR, CHF) также в узком диапазоне (менее 30–50 пунктов) перед началом открытия европейской сессии (до 06-00GMT-07-00GMT) с применением методики Pivot Points.

2 часть - Нюансы работы по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 11.09.2006

Типы нестандартных участков рынка. Нестандартный участок №2.

В предыдущей статье («Типы нестандартных участков. Нестандартный участок №1»), мы подробно рассмотрели ситуацию, когда цена большую часть всего дня (вплоть до начала американской сессии – до 12-00GMT) находилась в узком диапазоне, и проанализировали возможность работы на подобном участке при помощи методики открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона.

В рамках настоящей статьи мы постараемся дать рекомендации по новому способу работы по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday» в той ситуации, когда цена также находится в узком диапазоне, но только в самом начале европейской сессии (с 06-00GMT).

На первый взгляд, кажется, что в данном случае также можно рассмотреть возможность торговли с помощью «метода открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона», подробно описанный в предыдущей статье. Но в реальности ситуация выглядит намного сложнее. В качестве примера возьмём график EUR за 26.04.2006, представленный на рис. 1.



Рис. 1. EUR. Флетовый участок. Использование «метода открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона» на нестандартном участке №2 привело к получению убытка.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

На данном графике на 06-00GMT отчётливо виден узкий канал, имеющий ширину равную 27 пунктам (High **1,2434** (свеча за 00-50GMT) – точка №1 и Low **1,2407** (свеча за 04-10GMT) – точка №2).

При этом на 06-00GMT касания ни верхней, ни нижней границы конверта из 34EMA не наблюдается и открытие позиции согласно правилам работы на флетовом участке рынка не представляется возможным. В этом случае работа на пробой данного канала привела бы к получению убытка (после того как в 08-00GMT цена пробила нижнюю границу канала и была открыта позиция по цене **1,2402** (точка №3), были автоматически (ордер If Done) выставлены ордера Stop-Loss на уровне **1,2440** и Take-Profit на уровне **1,2345**. В 13-10GMT по цене **1,2440** был зафиксирован убыток в размере **-38** пунктов.

Как видно данный метод не всегда эффективно работает в самом начале торгового дня и часто приводит к получению убытков. Поэтому на флетовом и трендовом участках мы будем работать в строгом соответствии с правилами торговой системы «Консервативный скальпинг intraday», при этом в случае идентификации на 06-00GMT неоднозначного участка с преобладанием трендовой составляющей и наличия узкого канала 30–50 пунктов, рассмотрим новые возможности открытия и последующего ведения позиций на данном участке.

В качестве примера работы на неоднозначном участке рынка в самом начале дня (06-00GMT) возьмём график GBP за 26.03.2006, представленный на рис. 2.



Рис. 2. GBP. Неоднозначный участок. Анализ возможности применения установки ордера stop-reverse («стоп-переворот») на границе канала.

На данном графике на 06-00GMT отчётливо виден узкий канал, имеющий ширину равную 28 пунктам (Low **1,7333** (свеча за 00-20GMT) – точка №1 и High **1,7361** (свеча за 03-20GMT) – точка №2).

При этом с 07-10GMT цена несколько раз отбивалась от срединной 34EMA и вспомогательной 72EMA, и в соответствии с правилами работы для неоднозначного участка рынка, возможно, было открыть короткую позицию с уровня **1,7340** после пересечения линий Stochastics или, дождавшись подтверждения MACD, открыть короткую позицию с уровня **1,7330**. Ещё один вариант заключался в применении «метода открытия позиции при расширении внутридневного торгового диапазона» при открытии короткой позиции с уровня **1,7325** (свеча за 08-00GMT) – точка №3. К сожалению, главный минус заключался в том, что оба данных способа приводили к получению убытка в размере 30-40 пунктов (точные варианты открытия и закрытия позиций в обоих случаях рекомендуем просчитать самостоятельно).

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

Дело в том, что текущая ситуация на рынке кардинально изменилась и цена не пройдя поддержку на уровне **1,7310**, начала «отбиваться» вверх. Такая ситуация довольно часто встречается в первые несколько часов торгового дня, когда цена той или иной валюты сначала совершает ложный пробой одного текущего дневного экстремума, а потом начинает идти в противоположном направлении под влиянием фундаментальных или технических факторов.

В данном случае, руководствуясь правилами торговой системы «Консервативный скальпинг intraday», мы бы не смогли бы открыть новую позицию в противоположном направлении из-за отсутствия отбойных сигналов от EMA. Поэтому крайне интересным и изящным выходом из-за описываемой ситуации является установка ордера stop-reverse («стоп-переворот») вместо стандартного ордера stop-loss на противоположную границу канала, чуть выше дневного экстремума. В данном случае на уровень **1,7361** плюс **10** пунктов – уровень **1,7371** – точка №4.

При этом ордер Stop-Loss устанавливается стандартным для GBP при работе на неоднозначном участке, равным 40 пунктам, а ордер Take-Profit согласно рекомендуемому коэффициенту нормальной доходности $K_d = 1,5-2,0$ в размере 60 – 80 пунктов (в данном примере мы установим ордер Take-Profit с использованием методики Pivot Points на уровень сопротивления первого приближения – R1, как самый ближайший, так как мы не знаем, сможет ли цена пойти дальше вверх или опять развернется вниз).

Дальнейшее развитие событий полностью подтвердило выбранный нами план работы на данном участке рынке. После того как в 13-50GMT цена пробилла верхнюю границу канала и была открыта позиция по цене **1,7371** (точка №4), были автоматически (ордер If Done) выставлены ордера Stop-Loss на уровне **1,7331** и Take-Profit на уровне **1,7440**. В 18-20GMT по цене **1,7440** была зафиксирована прибыль в размере **+69** пунктов, а с учётом ранее полученного убытка, по итогам дня общая прибыль составила **+29/+39** пунктов. В результате мы не только отыграли убыток, но и ещё немного заработали.

В заключение хотелось бы сказать несколько слов о торговле при использовании данного метода. Всё-таки приоритет рекомендуется отдавать базовым (основным) сигналам, которые подробно разобраны в книге «Консервативный скальпинг intraday», а работа с помощью метода открытия позиции при расширении внутрисдневного торгового диапазона, а также использованием дополнительного ордера stop-reverse, целесообразна только **в случае принятия трейдером чёткого решения (в том числе и взятия повышенных рисков)** об отказе торговли по базовым правилам из-за возможности извлечь наибольшую выгоду ввиду сложившейся нестандартной ситуации на рынке.

3 - Неоднозначные участки рынка в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 19.11.2007

Неоднозначные участки рынка в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

1. Общая классификация участков рынка.

В данной статье будут рассмотрены основные принципы и правила работы на неоднозначных участках рынка в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday». В настоящей редакции пособия данные вопросы освещены не совсем подробно и есть некоторые противоречия в идентификации правил работы на данных участках.

В общем случае под **«неоднозначным участком рынка»** в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday» понимается такой участок рынка, на котором достаточно трудно определить текущее состояние рынка в терминах «тренд»/«флет» и при этом на неоднозначном участке наблюдаются характерные отличительные черты, как трендового, так и флетового участков согласно общей классификации в рассматриваемой торговой системе.

В рамках настоящей статьи мы дадим чёткое определение и методику идентификации неоднозначных участков рынка, а также предложим рекомендации по наиболее эффективным способам торговли на указанных участках согласно базовым правилам торговой системы «Консервативный скальпинг intraday».

Хотелось бы обратить Ваше внимание, что с января 2007 года общая классификация участков рынка в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday» несколько видоизменилась. Теперь все участки рынка подразделяются на участки **ТРЕНДОВОЙ** группы и **ФЛЕТОВОЙ** группы, при этом:

К участкам **ТРЕНДОВОЙ** группы относятся следующие участки рынка:

1. Трендовый участок рынка.
2. Неоднозначный участок с трендовой составляющей.

К участкам **ФЛЕТОВОЙ** группы относятся следующие участки рынка:

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

3. Флетовый участок рынка.
4. Неоднозначный участок с флетовою составляющей.

Идентификация и работа на участках №1 и №3 ведётся в строгом соответствии с базовыми правилами торговой системы «Консервативный скальпинг intraday», описанным в соответствующей книге, а методику работы на участках №2 и №4 в данной статье мы рассмотрим более подробно. Итак...

2. Неоднозначный участок с трендовой составляющей.

Особенности: расстояние между 144ЕМА, 72ЕМА и 34ЕМА не превышает 20 пунктов, но имеется выраженный характер направленного движения вверх или вниз. В этом случае, чем больше будет расстояние/расхождение между данными ЕМА, а угол роста/падения ЕМА будет увеличиваться, то тем ярче выражена трендовая составляющая рассматриваемого участка.

Отбойные сигналы: при работе на неоднозначном участке с трендовой составляющей во внимание принимаются простые (от одной ЕМА) и сложные (от нескольких ЕМА) отбойные сигналы. Как правило, отбойные сигналы на неоднозначном участке с трендовой составляющей идентифицируются при одинарном (простом) отбое от 34ЕМА или двойном (сложном) отбое от 34ЕМА и 72ЕМА, реже при тройном отбое от 34ЕМА, 72ЕМА и 144ЕМА одновременно. При этом любые отбойные сигналы от границ конверта на данном участке **НЕ** рассматриваются!

Вход в рынок: вход в рынок осуществляется ТОЛЬКО после пересечения линий %K и %D Stochastics после идентификации отбойных сигналов на данном участке рынка. При этом зона пересечения линий не играет никакой роли.

Правила установки ордеров Stop-Loss и Take-Profit:

Выставление ордера Stop-Loss (S/L):

- для EUR: 30-35 пунктов, для GBP и CHF: 35-40 пунктов.

Выставление ордера Take-Profit (T/P):

- для EUR: 40-45 пунктов, для GBP и CHF: 50-60 пунктов (также рекомендуется использовать методику Pivot Points для более грамотного расчёта целевых уровней установки ордера Take-Profit).

В качестве примера работы на неоднозначном участке рынка с трендовой составляющей рассмотрим график GBP за 10.10.2007, представленный на рис. 1.



Рис. 1. GBP/USD. Неоднозначный участок с трендовой составляющей.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

На данном графике с 06-00GMT наблюдается неоднозначный участок рынка с трендовой составляющей – расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA составляет 18-20 пунктов, но имеется выраженный характер направленного движения EMA вверх – зона №0.

При этом с 06-40GMT/06-50GMT цена демонстрирует двойной отбойный сигнал от срединной 34EMA и вспомогательной 72EMA, и в соответствии с вышеуказанными правилами работы для неоднозначного участка рынка с трендовой составляющей, возможно, было открыть длинную позицию с уровня **2,0399** – точка №1 после пересечения линий Stochastics.

Ордер Stop-Loss устанавливается в размере 35 пунктов на уровне **2,0364**, а ордер Take-Profit можно было выбрать двумя способами:

1. Фиксированный ордер Take-Profit, согласно рекомендуемому коэффициенту нормальной доходности $K_d = 1,5-2,0$ в размере 60–70 пунктов (в данном примере мы установим ордер Take-Profit на уровень **2,0459** – точка №2).

2. Уровень ордера Take-Profit устанавливается согласно правилам работы по методике Pivot Points на уровень сопротивления второго приближения – **R2 (2,0475)** – точка №3.

Дальнейшее развитие событий полностью подтвердило выбранный нами план работы на данном участке рынке. После того как в 09-40GMT цена достигла уровня **2,0459** – точка №2 была зафиксирована прибыль в размере **+60 пунктов** (вариант №1), а те кто решил работать по второму варианту выбрали идеальный вариант закрытия позиции точно на максимуме (HIGH) дня (и всё благодаря уровням Pivot Points!) – уровень **2,0475** – точка №3. В 09-50GMT по цене **2,0475** была зафиксирована прибыль в размере **+76 пунктов** (вариант №2).

3. Неоднозначный участок с флетовой составляющей.

Особенности: расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA превышает 20 пунктов, но выраженный характер направленного движения отсутствует. В этом случае параллельность и направление движения EMA особой роли не играет. Здесь важно само расстояние между EMA и динамика сближения/расхождения данных EMA. Поэтому, чем меньше будет указанное расхождение, то тем больше выражена флетовая составляющая рассматриваемого участка.

Отбойные сигналы: при работе на неоднозначном участке с флетовой составляющей во внимание принимаются ТОЛЬКО комбинированные (от границы конверта и одной из EMA, расположенных внутри конверта) отбойные сигналы от EMA. Как правило, отбойный сигнал на неоднозначном участке с флетовой составляющей идентифицируется при комбинированном отбое от границы конверта в сочетании с отбойным сигналом от 144EMA одновременно.

Вход в рынок: вход в рынок осуществляется ТОЛЬКО после пересечения линий %K и %D Stochastics в зонах перекупленности и перепроданности после идентификации отбойных сигналов на данном участке рынка.

Правила установки ордеров Stop-Loss и Take-Profit:

Выставление ордера Stop-Loss (S/L):

- для EUR: 30-35 пунктов, для GBP и CHF: 35-40 пунктов.

Выставление ордера Take-Profit (T/P):

- для EUR, GBP и CHF функцию данного ордера играет противоположная от открытия позиции, сторона конверта.

Отдельно хотелось бы подчеркнуть, что при открытии позиции на неоднозначном участке с флетовой составляющей, что чем больше будет дополнительных сигналов (например, наличия дивергенции, свечных моделей разворота и т.п.), то тем больше будет вероятность открытия позиции в нужном нам направлении.

Мои общие рекомендации при работе на неоднозначных участках с флетовой составляющей выглядят следующим образом:

1. Открывать позиции только после идентификации комбинированных отбойных сигналов (от границ конверта и EMA).

2. Выставлять ордер Stop-Loss на последний локальный экстремум.

3. Выбор целевых ориентиров выставления ордера Take-Profit должен носить краткосрочный характер удержания/сопровождения позиции.

В любом случае, как я не раз уже говорил в книге и на форумах, риск при открытии позиции на неоднозначных участках с флетовой составляющей крайне высокий.

В качестве примера работы на неоднозначном участке рынка с флетовой составляющей рассмотрим график GBP за 16.08.2007, представленный на рис. 2.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй



Рис. 2. GBP/USD. Неоднозначный участок с флетовою составляющей.

На данном графике с 06-00GMT наблюдается трендовый участок рынка – расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA составляет более 20 пунктов, главная 144EMA находится вблизи верхней границы конверта. Вопросы о правилах и нюансах работы на подобных участках рынка уже много раз разбирались и препарировались в пособии и на форумах.

Но уже с 12-00GMT мы видим, что 34EMA начала разворачиваться против доминирующего down-trend-a, при этом расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA превышает 20 пунктов, но выраженный характер направленного движения отсутствует, а вспомогательная 72EMA становится параллельной временной оси – зона №0.

При этом с 13-30GMT/13-40GMT цена демонстрирует комбинированный отбойный сигнал: от верхней границы конверта и от главной 144EMA, формируя свечную модель разворота «падающая звезда». В соответствии с вышеуказанными правилами работы для неоднозначного участка рынка с флетовою составляющей, возможно, было открыть короткую позицию с уровня **1,9861** – точка №1 после обязательного пересечения линий Stochastics в зоне перекупленности.

Ордер Stop-Loss устанавливается в размере 30 пунктам на уровне **1,9891**, а ордер Take-Profit выставлялся на противоположную границу конверта от точки открытия позиции на уровень **1,9795** – точка №2.

Дальнейшее развитие событий полностью подтвердило выбранный нами план работы на данном участке рынке. После того как в 16-10GMT цена достигла уровня **1,9795** – точка №2 была зафиксирована прибыль в размере **+66 пунктов**.

!Важно:

1. Прошу Вас относиться к данной формализации с *пониманием логики происходящих на рынке процессов* при идентификации неоднозначных участков рынка по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday».

Например, если указано: «на неоднозначном участке с трендовой составляющей основной особенностью является то, что расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA не превышает 20 пунктов, но имеется выраженный характер направленного движения вверх или вниз», а расстояние между средним всё-таки превышает 20 пунктов (22 или 24 пункта) не следует сразу же относить данный участок к чисто трендовому, так как неоднозначность, как правило, в подобных случаях будет сохраняться.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

2. В данной статье расчёты по ведению всех рассматриваемых позиций осуществлялся без учёта спреда по валютной паре GBP/USD.

4 - Нюансы работы с валютными парами (кросс-курсами) EUR/JPY и GBP/JPY в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 19.11.2007

Нюансы работы с валютными парами (кросс-курсами) EUR/JPY и GBP/JPY в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

1. Общие положения.

Как Вы хорошо знаете, в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday» работа с валютной парой USD/JPY не предусмотрена (подробно данный вопрос разбирается в разделе 2.2.4. пособия). В связи с этим может показаться, что вопрос о работе с такими волатильными кросс-курсами как EUR/JPY и GBP/JPY не стоит даже теоретически.

Но если внимательно разобраться в данной проблеме, то в целом указанные валютные пары не особенно отличаются от других торговых инструментов на FOREX за исключением высокой волатильности внутри дня, а также использования USD/JPY в сделках carry-trade, когда за низкодоходные (с наименьшими процентными ставками) валюты одной страны (например, Япония) покупаются высокодоходные (с наибольшими процентными ставками) валюты другой страны (например, Новая Зеландия), облигации и другие денежные инструменты.

В данной статье будут рассмотрены основные нюансы работы с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY согласно базовым правилам работы торговой системы «Консервативный скальпинг intraday».

2. Особенности и нюансы работы с EUR/JPY и GBP/JPY.

Нюанс №1. Время работы.

Идентификация отбойных сигналов и открытие позиций по валютным парам EUR/JPY и GBP/JPY происходит **круглосуточно!** Причина очевидна, так как в рассматриваемом кросс-курсе есть и EUR/USD, и GBP/USD, и USD/JPY, то движение по GBP/JPY и/или EUR/JPY может начаться в любое время вне зависимости от торговых сессий, на которых будут поступать данные сигналы. Обязательного закрытия позиции в 20-00GMT не предусмотрено. При этом факторы фундаментального характера (новости, выступления чиновников ЦБ и т.п.) при работе с EUR/JPY и GBP/JPY не учитываются.

Нюанс №2. Тайм-фреймы и индикаторы.

Работа с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY ведётся только на 10-минутном тайм-фрейме без использования четырёхчасовых графиков. При этом параметры и построение индикаторов/осцилляторов при работе с EUR/JPY и GBP/JPY происходит в строгом соответствии с общей установленной методикой в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday».

Нюанс №3. Участки рынка.

Идентификация отбойных сигналов по валютным парам EUR/JPY и GBP/JPY рассматривается **ТОЛЬКО** на участках **ТРЕНДОВОЙ группы**, то есть на трендовом участке и на неоднозначном участке с трендовой составляющей (методика работы на данных участках подробно разбирается в пособии и в соответствующей статье на данном форуме). В связи с этим ЕМА, образующие границы конверта с рабочего графика полностью убираются!

Нюанс №4. Отбойные сигналы.

При работе с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY на участках ТРЕНДОВОЙ группы во внимание принимаются любые отбойные (как простые, так и сложные) сигналы от 34ЕМА, 72ЕМА и 144ЕМА.

Нюанс №5. Вход в рынок.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

При работе с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY на участках ТРЕНДОВОЙ группы вход в рынок осуществляется ТОЛЬКО после пересечения линий %K и %D Stochastics после идентификации отбойных сигналов на данном участке рынка. При этом зона пересечения линий не играет никакой роли.

Нюанс №6. Правила установки ордеров Stop-Loss и Take-Profit:

При работе с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY ордер Stop-Loss (S/L) выставляется в размере 40 пунктов (с учётом спреда) для EUR/JPY и 50 пунктов (с учётом спреда) для GBP/JPY, а ордер Take-Profit (T/P) может быть выставлен двумя способами:

1. Фиксированный ордер Take-Profit, согласно рекомендуемому коэффициенту нормальной доходности $K_d = 1,5-2,0$, но не менее 40 пунктов для EUR/JPY (рекомендую 50-70 пунктов) и не менее 50 пунктов для GBP/JPY (ориентировочная рекомендуемая величина данного ордера составляет 70-90 пунктов).

2. Уровень ордера Take-Profit устанавливается согласно правилам работы по методике Pivot Points, но не менее 40 пунктов для EUR/JPY и не менее 50 пунктов для GBP/JPY. Также рекомендуется использовать методику работы с ордером Trailing-Stop (T/S), описываемую в разделе 4.4.1. пособия «Консервативный скальпинг intraday».

Примеры работы на участках ТРЕНДОВОЙ группы с валютными парами EUR/JPY и GBP/JPY в конце октября 2007 года проиллюстрированы на следующих графиках (смотрите рис. 1 и рис. 2):

3. Пример работы с валютной парой EUR/JPY.



Рис. 1. EUR/JPY. Неоднозначный участок с трендовой составляющей.

На данном графике с 11-30GMT из флетового участка (на нём мы не работаем!) начинает формироваться неоднозначный участок рынка с трендовой составляющей, постепенно переходящий в трендовый. При этом расстояние между 144EMA, 72EMA и 34EMA составляет 10-15 пунктов и имеется выраженное направление ЕМА вверх – зона №0.

В 11-40GMT цена демонстрирует двойной отбойный сигнал от срединной 34EMA и вспомогательной 72EMA, и в соответствии с правилами работы для неоднозначного участка с трендовой составляющей, возможно, было открыть длинную позицию с уровня 165,24 – точка №1 после пересечения линий Stochastics.

Ордер Stop-Loss устанавливается в размере 40 пунктов на уровне 164,84, а ордер Take-Profit можно было выбрать двумя способами:

1. Фиксированный ордер Take-Profit, согласно рекомендуемому коэффициенту нормальной доходности $K_d = 1,5-2,0$ в размере 50-70 пунктов (в данном примере мы установим ордер Take-Profit на уровень 165,84 – точка №2).

Консервативный скальпинг intraday. Раздел 8. Практика: Вопросы и ответы. Решение задач.

статья от 09.10.2006

Консервативный скальпинг intraday. Раздел 8. Практика: Вопросы и ответы. Решение задач.

По многочисленным просьбам читателей в данной статье будут приведены подробные ответы к разделу **8. Практика. Вопросы и ответы** книги «Консервативный скальпинг intraday». Данный материал является справочным и в первую очередь служит в качестве проверки собственных вариантов решений задач, представленных в разделе 8 учебного пособия.

В задачах №1, №5 и №7 раздела 8 в результате опечатки приведены ошибочные даты (график валютной пары не соответствует дате, указанной в описании задачи). В настоящей статье все графики торговых инструментов будут аналогичны графикам, представленным в книге, а даты рассматриваемых событий будут обновлены.

8.1. Задача №1.

На рис. 8.1. изображён 10-минутный график Евро (EUR) за 04.10.2004. Ответьте на следующие вопросы:

1. Оцените возможность открытия позиции без использования осцилляторов. Укажите время и уровень входа в рынок.
2. Рассмотрите вероятность эффективного расчёта целей для фиксирования прибыли с помощью методики Pivot Points.
3. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.1. EUR, 10-минутный график. Трендовый участок рынка.

Ответ на задачу №1.

Открытие позиции без использования осциллятора Stochastics, позволяющего осуществить вход в рынок после идентификации отбойных сигналов, правилами торговой системы «Консервативный скальпинг intraday» (далее ТС КС) не предусмотрено. При этом на трендовом участке рынка не наблюдалось идентификации отбойных сигналов от экспоненциальных скользящих средних.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС и не предполагали ответов на поставленные вопросы.

8.2. Задача №2.

На рис. 8.2. изображён 10-минутный график Швейцарского Франка (CHF) за 18.01.2005. Ответьте на следующие вопросы:

1. Рассмотрите варианты открытия позиции в точках 1,2,3. Укажите время и уровни входа в рынок. Выделите наиболее эффективные зоны открытия позиций с точки зрения расчётной прибыли.
2. Можно ли было применить методика Pivot Points для фиксирования прибыли в контексте предлагаемой рыночной ситуации.
3. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.2. CHF, 10-минутный график. Флетовый участок рынка.

Ответ на задачу №2.

1. Согласно правилам ТС КС в точке 1 наблюдался трендовый участок рынка и поэтому отбойный сигнал от верхней границы конверта во внимание не принимался. В точке 2 наблюдался неоднозначный участок рынка, при этом отбойный сигнал начал формироваться только с 11-30/11-50GMT. В данном случае открытие длинной позиции было возможно в 12-10GMT по цене 1,1813. В точке 3 наблюдался флетовый участок рынка, и после идентификации отбойного сигнала от верхней границы в 15-40/16-00GMT, дождавшись пересечений линий Stochastics в зоне перекупленности, была возможность открытия короткой позиции по цене 1,1870 в 16-00GMT

2. Методика Pivot Points используется для фиксирования прибыли только на трендовом участке рынка. При работе на флетовом участке рынка в качестве уровней выставления ордеров take-profit выступает противоположная граница конверта.

3. Открытая длинная позиция в 12-10GMT по цене 1,1813 в 11-50GMT была закрыта по ордеру take-profit, выставленному на противоположную границу канала по цене 1,1866, а открытая короткая позиция в точке 3 по цене 1,1870 в 16-00GMT была закрыта принудительно в 20-00GMT по цене 1,1867. При открытии позиции в точке 2 прибыль составила **+53 пункта** без учёта спреда, а при открытии позиции в точке 3 прибыль составила **-1 пункт** без учёта спреда.

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС при работе на неоднозначном и флетовом участках рынка.

8.3. Задача №3.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

На рис. 8.3. изображён 10-минутный график Швейцарского Франка (CHF) за 24.11.2004. Ответьте на следующие вопросы:

1. Проанализируйте ситуацию на рынке на наличие тренда, при помощи четырёхчасового графика по данной валютной паре. Рассмотрите варианты открытия позиции в точке 1. Укажите время и уровень входа в рынок.
2. Можно ли было войти в рынок раньше, и если да, то также укажите время и уровень входа в рынок.
3. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.3. CHF, 10-минутный график. Трендовый участок рынка.

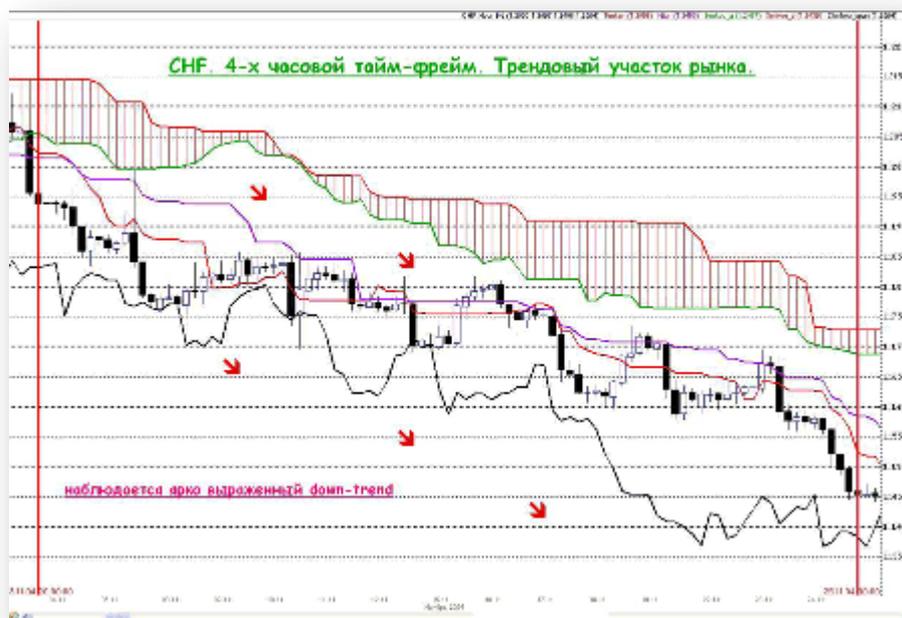


Рис. 8.3.1. CHF, 4-х часовой график. Трендовый участок рынка.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

Ответ на задачу №3.

1. На четырёхчасовом графике наблюдался ярко выраженный нисходящий трендовый участок (рис 8.3.1), при этом аналогичная ситуация сложилась и на 10-минутном тайм-фрейме. Согласно правилам ТС КС в точке 1 наблюдался трендовый участок рынка, и после идентификации отбойного сигнала от срединной 34ЕМА в 15-50/16-00GMT, дождавшись пересечения линий Stochastics, была возможность открытия короткой позиции в точке 1 по цене 1,1498 в 16-20GMT.

2. По методике Pivot Points было бы наиболее эффективно, открывшись в точке 1 поставить ордер take-profit на уровень S3 – 1,1397.

3. Возможность осуществления более раннего входа в рынок была в 07-40GMT после идентификации отбойного сигнала от срединной и вспомогательной ЕМА. Открытие короткой позиции в данной точке осуществлялось с помощью осциллятора Stochastics по цене 1,1556 в 08-30GMT.

4. Открытая короткая позиция в точке 1 могла быть частично закрыта на уровне S2 – 1,1478 (прибыль составила **+20 пунктов** без учёта спреда), или принудительно в 20-00GMT по цене OPEN данной свечи – 1,1458 (прибыль составила **+40 пунктов** без учёта спреда).

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС, при работе на трендовом участке рынка с применением методики Pivot Points.

8.4. Задача №4.

На рис. 8.4. изображён 10-минутный график Евро (EUR) за 27.10.2004. Ответьте на следующие вопросы:

1. Рассмотрите варианты открытия позиции в точках 1,2,3. Укажите время и уровни входа в рынок. Выделите наиболее эффективные зоны открытия позиций с точки зрения получения расчётной прибыли.

2. Проанализируйте ситуацию на рынке после открытия позиции в точке 1. Можно ли было пропустить данный сигнал?

3. Считаете ли вы ошибкой вхождение в рынок в точке 2, и, если да, то почему?

4. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.4. EUR, 10-минутный график. Флетовый участок рынка.

Ответ на задачу №4.

1. Согласно правилам ТС КС в точках 1, 2 и 3 наблюдался флетовый участок рынка и отбойные сигналы от скользящих средних (144ЕМА, 72ЕМА и 34ЕМА) во внимание не принимались. В точках 2 и 3 было возможно открытие короткой позиции после идентификации отбойных сигналов от верхней

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

границы в 11-30/11-50GMT (точка 2) и 12-50/13-00GMT (точка 3). При этом, дождавшись пересечений линий Stochastics в зоне перекупленности, была возможность открытия короткой позиции по цене 1,2784 в 11-50GMT (точка 2) и по цене 1,2797 в 13-20GMT.

2. В точке 1 был идентифицирован флетовый участок рынка и согласно правилам ТС КС отбойные сигналы от скользящих средних (144ЕМА, 72ЕМА и 34ЕМА) необходимо было игнорировать.

3. Открытие позиции в точке 2 не являлось ошибкой и произошло в строгом соответствии с правилами ТС КС для работы на флетовом участке.

4. Открытая короткая позиция в точке 2 по цене 1,2784 в 11-50GMT была закрыта по ордеру take-profit, выставленному на противоположную границу канала по цене 1,2740, а открытая короткая позиция в точке 3 по цене 1,2797 в 13-20GMT была закрыта по ордеру take-profit, выставленному на противоположную границу канала по цене 1,2751. При открытии позиции в точке 2 прибыль составила **+44 пункта** без учёта спреда, а при открытии позиции в точке 3 прибыль составила **+46 пунктов** без учёта спреда.

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС, при работе на флетовом участке рынка.

8.5. Задача №5.

На рис. 8.5. изображён 10-минутный график Британского Фунта (GBP) за 28.09.2004. Ответьте на следующие вопросы:

1. Рассмотрите варианты открытия позиции в точках 1,2,3. Укажите время и уровни входа в рынок. Выделите наиболее эффективные зоны открытия позиций с точки зрения расчётной прибыли.
2. Считаете ли вы открытие позиции в точке 2 целесообразным. Проанализируйте показания индикатора MACD в этот момент времени.
3. Могло ли добавление Stochastics более чётко прояснить ситуацию на данном участке рынка? И если, да, то рассмотрите, вариант более позднего входа в рынок.
4. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.5. GBP, 10-минутный график. Неоднозначный участок рынка.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй



Рис. 8.5.1 GBP, 10-минутный график. Неоднозначный участок рынка. Добавление осциллятора Stochastics.

Ответ на задачу №5.

1. Для анализа вариантов открытия позиции в точках 1,2,3 необходимо в обязательном порядке добавить на график осциллятор Stochastics (рис. 8.5.1). Согласно правилам ТС КС в точках 1 и 3 наблюдался неоднозначный участок рынка, и отбойные сигналы могли приниматься от всех скользящих средних, включая границы конверта (144EMA, 72EMA и 34EMA), при этом приоритет отдавался отбойным сигналом от главной 144EMA и вспомогательной 72EMA. В точке 2 отбойного сигнала от верхней границы конверта не наблюдалось. В точках 1 и 3 было возможно открытие длинной позиции после идентификации отбойных сигналов от главной 144EMA в 06-10/06-30GMT (точка 1) и от нижней границы конверта 16-10/16-30GMT (точка 3). При этом, дождавшись пересечений линий Stochastics, была возможность открытия длинной позиции по цене 1,8089 в 06-40GMT (точка 2) и по цене 1,8091 в 16-40GMT.

2. Открытие позиции в точке 2 не представлялось возможным, так как отсутствовали отбойные сигналы от скользящих средних. По этой же причине анализ показаний осцилляторов во внимание не принимался.

3. В соответствии с правилами ТС КС использование осциллятора Stochastics является необходимым условием для открытия позиции на любом из анализируемых участков рынка.

4. Открытая длинная позиция в точке 1 по цене 1,8089 в 06-40GMT была закрыта по ордеру take-profit, выставленному на рекомендуемый фиксированный размер = 60 пунктам, по цене 1,8149, а открытая длинная позиция в точке 3 по цене 1,8091 в 16-40GMT была закрыта принудительно в 20-00GMT по цене OPEN данной свечи – 1,8120. При открытии позиции в точке 1 прибыль составила **+60 пункта** без учёта спреда, а при открытии позиции в точке 3 прибыль составила **+29 пунктов** без учёта спреда.

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС, при работе на неоднозначном участке рынка.

8.6. Задача №6.

На рис. 8.6. изображён 10-минутный график Евро (EUR) за 21.03.2005. Ответьте на следующие вопросы:

1. Проанализируйте ситуацию на рынке на наличие тренда, при помощи четырёхчасового графика по данной валютной паре. Рассмотрите варианты открытия позиции в точках 1,2,3. Укажите время и уровни входа в рынок.

2. Каким образом можно было наиболее эффективно применить методику Pivot Points для фиксирования прибыли в контексте предлагаемой рыночной ситуации. Попробуйте рассмотреть все возможные варианты.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

3. Считаете ли вы ошибкой вхождение в рынок в точке 3, и, если да, то почему?
4. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.6. EUR, 10-минутный график. Трендовый участок рынка.

Ответ на задачу №6.

1. На четырёхчасовом графике по данной валютной паре наблюдался краткосрочный нисходящий тренд. При дальнейшей работе на 10-минутном графике приоритет следовало отдавать коротким позициям по EUR/USD. Согласно правилам ТС КС в точках 1, 2 и 3 наблюдался трендовый участок рынка, но действительные отбойные сигналы от срединной 34EMA поступали только в точках 1 и 3. При этом после идентификации отбойных сигналов в указанных точках: в точке 1 – 07-20/07-30GMT, в точке 3 – 15-00/15-10GMT, дождавшись пересечения линий Stochastics, была возможность открытия короткой позиции в точке 1 по цене 1,3260 в 07-40GMT и в точке 3 по цене 1,3178 в 15-30GMT.
2. По методике Pivot Points было бы наиболее эффективно, открывшись в точке 1 поставить ордер take-profit на уровень S3 – 1,3130, при этом на уровне S2 – 1,3196 возможно было зафиксировать часть прибыли и/или осуществить операцию «добавление к позиции»,
3. Открытие позиции в точке 3 не являлось ошибкой, так как все сигналы на вход в рынок, поступающие от индикаторов соответствовали правилами ТС КС.
4. Открытая короткая позиция в точке 1 могла быть закрыта на уровне S2 – 1,3196 (прибыль составила **+64 пункта** без учёта спреда) или принудительно в 20-00GMT по цене OPEN данной свечи – 1,3165 (прибыль составила **+95 пунктов** без учёта спреда).

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС при работе на трендовом участке рынка с применением методики Pivot Points.

8.7. Задача №7.

На рис. 8.7. изображён 10-минутный график Британского Фунта (GBP) за 21.04.2005. Ответьте на следующие вопросы:

1. Рассмотрите варианты открытия позиции в точках 1,2,3. Укажите время и уровни входа в рынок. Выделите наиболее эффективные зоны открытия позиций с точки зрения расчётной прибыли.
2. Проанализируйте показания индикаторов с текущей ситуацией на рынке в точках 1,2. В какой зоне, на Ваш взгляд, было безопаснее всего входить в рынок?
3. Оцените прибыль/убыток, полученный при анализе рассматриваемого участка рынка.

Для аналитических и практических расчётов используйте программу технического анализа Rumus.



Рис. 8.7. GBP, 10-минутный график. Неоднозначный участок рынка.

Ответ на задачу №7.

1. Согласно правилам ТС КС в точках 1 и 2 наблюдался флетовый участок рынка и отбойные сигналы от скользящих средних (144EMA, 72EMA и 34EMA) во внимание не принимались. В точке 3 был неоднозначный участок с ярко выраженной трендовой составляющей, и после идентификации отбойного сигнала в 15-00/15-10GMT, дождавшись пересечения линий Stochastics в зоне перекупленности, была возможность открытия короткой позиции по цене 1,9120 в 15-30GMT.

2. Несмотря на то, что в точках 1 и 2 осциллятор Stochastics подавал сигналы на вход в рынок, принимать их во внимание было нельзя, так как отсутствовали отбойные сигналы от границ конверта на флетовом участке рынка (см. ответ п.1 к задаче №7). В точке 3 наблюдался сигнал на единственно верный и безопасный вход в рынок.

3. Открытая короткая позиция в точке 3 была закрыта принудительно в 20-00GMT по цене OPEN данной свечи – 1,9086. Общая прибыль составила **+34 пункта** без учёта спреда.

Комментарии к задаче: Условия данной задачи были направлены на усвоение базовых правил работы по ТС КС при работе на неоднозначном участке рынка.

Отбой и отбойные сигналы от ЕМА в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 26.05.2008

Отбой и отбойные сигналы от ЕМА в торговой системе «Консервативный скальпинг intraday».

Общие определения формализованного отбоя от ЕМА.

Всем доброго времени суток!

Ввиду того, что по поводу идентификации отбоя от ЕМА возникает много вопросов, в том числе и на спецфоруме, я ещё раз постараюсь сформулировать СВОЁ видение отбойных сигналов и всех составляющих элементов данной формализации применительно к ТС «Консервативный скальпинг intraday». При этом отбойные сигналы идентифицируются всегда одинаковым образом вне зависимости от валютной пары и периода/типа ЕМА.

Итак, приступим:

Формальные определения отбойных сигналов при работе с ТС Консервативный скальпинг intraday следующие:

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

1. «Заброс за ЕМА» – это прокол экстремумом хотя бы одной свечой уровня, образованного любой из ЕМА. В этом случае, отбойным сигналом от ЕМА, считается «заброс» на расстояние не более 20 пунктов + спред в зависимости от валютной пары.

2. «Недоход до ЕМА» – это недоход экстремума хотя бы одной свечой до уровня, образованного любой из ЕМА. Во втором случае, отбойным сигналом от ЕМА, считается «недоход» на расстояние не менее 2-х спредов в зависимости от валютной пары.

Теоретический (идеальный) отбойный сигнал от ЕМА выглядит следующим образом (на примере нисходящего движения на флетовом участке рынка):

Цена, снижаясь, касается, пункт в пункт, нижней границы конверта, образуя при этом свечную модель разворота «молот» (цвет тела свечи любой), будем называть подобные экстремальные свечи – «отбойными свечами». Слева от данной свечи – две чёрные свечи – справа две белые. Входим в рынок на любой из белых свечей после пересечения линий Stochastics, но только при обязательном условии превышения ценой закрытия одной из данных белых свечек, максимального значения той свечи, которая предшествовала отбойной свече.

Также по правилам ТС, отбойным сигналом считается, «заброс» экстремумом цены за ЕМА на расстояние не более 20 пунктов или «недоход» экстремумом цена на расстояние не менее спреда (в зависимости от выбранной для торговли валютной пары) с ОБЯЗАТЕЛЬНОЙ последующей коррекцией цены в сторону формирующегося отбоя от ЕМА.

На следующих двух графиках наглядно проиллюстрированы 2 типа отбойных сигналов:

1-й тип: «Отбойный сигнал с забросом от ЕМА».

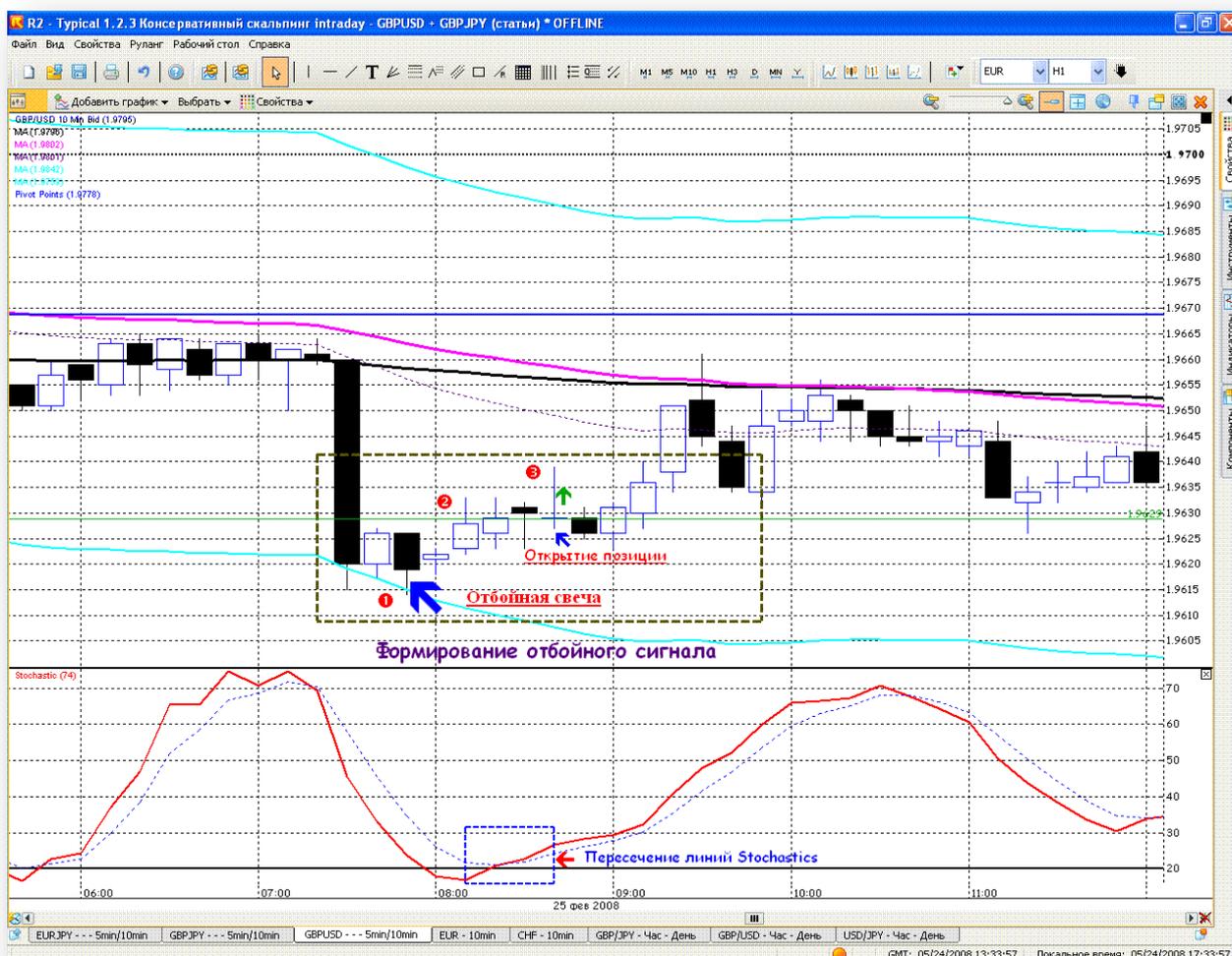


Рис. 1. GBP/USD. Флетовый участок. «Отбойный сигнал с забросом от ЕМА».

На данном графике показано формирование и реализация 1-го типа отбойного сигнала – «отбойный сигнал от ЕМА с забросом». Свечка под №1 является отбойной свечой, имеющей экстремум – Low 1,9614. Свечка №2 имеет цену закрытия выше значения экстремума свечи, которая предшествовала отбойной свече, следовательно, после закрытия свечи №2 имеем формирование отбойного сигнала от нижней границы конверта на флетовом участке рынка. Пересечение линий Stochastics, сформированное в зоне перепроданности на свечке за 08-30GMT, позволяет на свечке за 08-40GMT открыть длинную позицию с

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

уровня 1,9629 с целью на верхней границе конверта и ордером stop-loss на 1,9594. Дальнейшее развитие событий Вы можете самостоятельно рассмотреть, загрузив данный график за 25.02.2008г.

2-й тип: «Отбойный сигнал с недоходом до EMA».

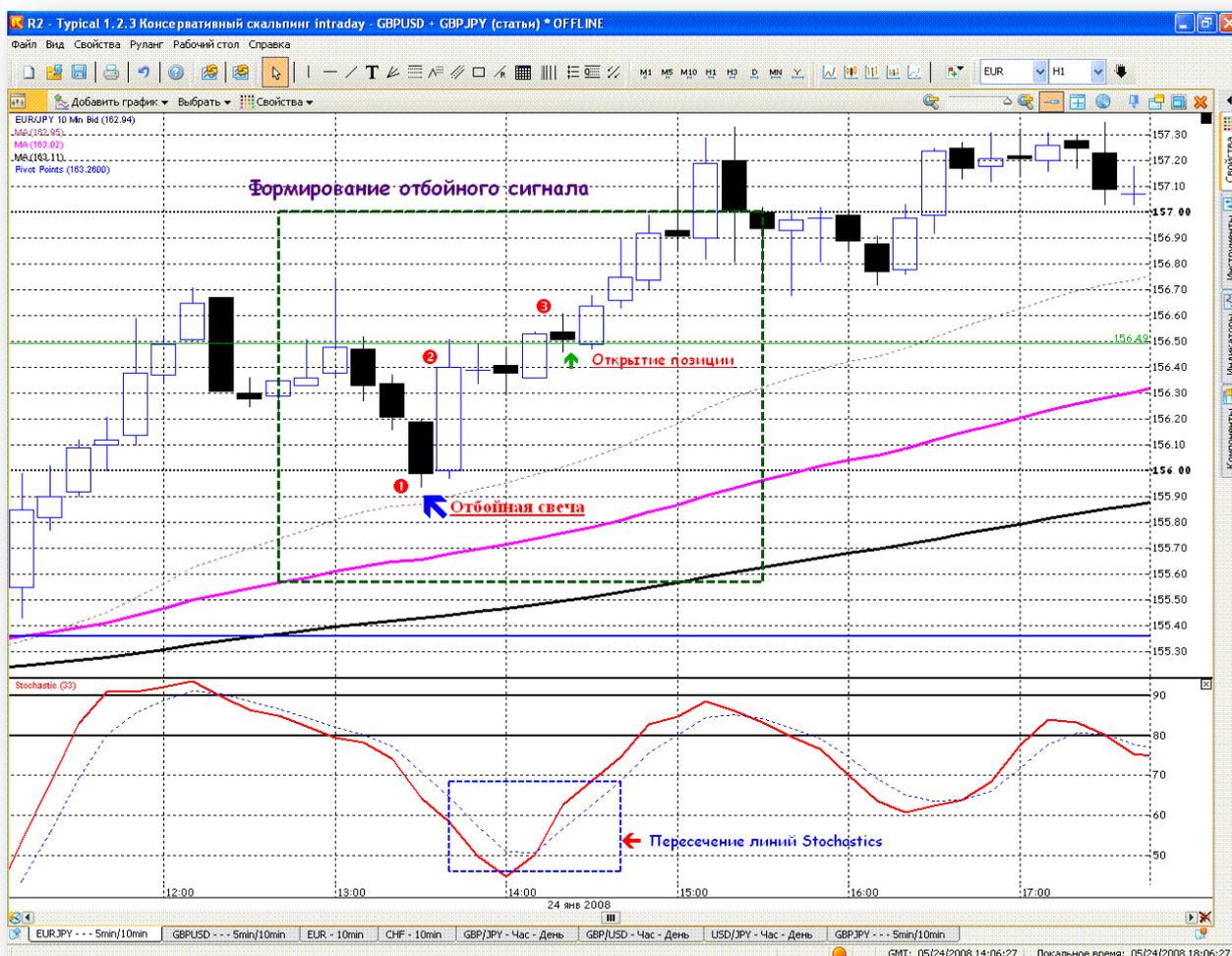


Рис. 2. EUR/JPY. Трендовый участок. «Отбойный сигнал с недоходом до EMA».

На данном графике показано формирование и реализация 2-го типа отбойного сигнала – «отбойный сигнал с недоходом до EMA». Свечка под №1 является отбойной свечой, имеющей экстремум – Low 155,94 и имеет недоход до срединной 34EMA, равный 7-и пунктам. Свечка №2 имеет цену закрытия выше значения экстремума свечи, которая предшествовала отбойной свече, следовательно, после закрытия свечи №2 имеем формирование отбойного сигнала от срединной 34EMA на трендовом участке рынка. Пересечение линий Stochastics, сформированное в зоне перепроданности на свечке за 14-20GMT, позволяет на свечке за 14-30GMT открыть длинную позицию с уровня 156,49 либо с фиксированными целями в размере 60-80 пунктов, либо по уровням Pivot Points и ордером stop-loss на 156,09. Дальнейшее развитие событий Вы можете самостоятельно рассмотреть, загрузив данный график за 24.01.2008г.

Практическое использование формализованного отбоя от EMA в работе по ТС «Консервативный скальпинг intraday».

Прилипание цены к EMA.

Поскольку идеальных отбойных сигналов не бывает, пытаемся вернуться в реальность. Что нам нужно для входа в рынок? Обязательно сначала идентифицировать отбойный сигнал, и только затем получить его подтверждение с помощью Stochastics (возможно использование дополнительного фильтра MACD). Кстати, пересечение линий Stochastics может произойти на 1-2 свечки, раньше, окончательной идентификации отбойного сигнала – такой вариант также считается рабочим.

1. Цена сформировала экстремум за EMA на расстоянии не более 20 + N пунктов и начала отбиваться. Будем ли считать данный сигнал отбойным? Возможно, что да, если например, N = 1-3, а если N = 4 и более? В данном случае вся ситуация очень сильно зависит от состояния (участка) рынка и формализовать данный отбой в пунктах до конца мне не удалось.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

Для себя я определил отбойный сигнал в данном варианте так: если цена сформировала экстремум за EMA на расстоянии не более $20 + N$ пунктов, где N = спред и начала отбиваться – работаем, нет – «сидим на заборе».

2. Цена сформировала экстремум за EMA на расстоянии не более спред + N пунктов и начала отбиваться. Будем ли считать данный сигнал отбойным? Опять же возможно, что да, если например, $N = 1-3$, а если $N = 4$ и более?

В данном случае на участках флетового группы я, как правило, жду ОБЯЗАТЕЛЬНОГО касания экстремумом цены границы конверта, а на участках трендовой группы определил отбойный сигнал следующим образом: если цена сформировала не дошла до EMA на расстоянии не менее $\text{спред} * 2$ – работаем, нет – «сидим на заборе» или смотрим на MACD.

Честно, даже не знаю смогу ли я объяснить, правила идентификации отбойных сигналов лучше, не говоря уже о формализации. На мой взгляд, при работе с данной ТС необходимо обращать внимание на текущее состояние рынка, а не мерить «по линейке» количество пунктов...

3. «Прилипание» цены к EMA является частным случаем классического (идеального) отбойного сигнала. Самое главное, чтобы отбойный сигнал был чёткий, при этом, как правило, двух-трёх свечей, в направлении отбоя бывает достаточно для его идентификации, а возвращение цены обратно к EMA в подобных ситуациях совершенно не принципиально.



Рис. 3. GBP/USD. Трендовый участок. «Прилипание цены к EMA».

На данном графике наглядно видно «прилипание цены» к 34EMA, что свидетельствует о возможном замедлении хода, но не является переломным моментом на нисходящем трендовом участке. В связи с этим не возобновляется открытие позиций согласно правилам работы на трендовом участке рынка в ТС «Консервативный скальпинг intraday».

Особенности использования MACD в работе по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday»

статья от 26.05.2008

Особенности использования MACD в работе по торговой системе «Консервативный скальпинг intraday».

Внимание:

Перед прочтением данной статьи рекомендуется ознакомиться с разделами 3.1.6. и 3.1.7 книги «Консервативный скальпинг intraday».

Общие нюансы работы с осциллятором MACD.

В книге «Консервативный скальпинг intraday» говорилось о том, что пересечение MACD центральной линии свидетельствует о продолжении тренда на выбранном тайм-фрейме. Однако, на 10-минутных графиках, такое пересечение зачастую свидетельствует о скором затухании тренда, и последующем его окончании. Поэтому пересечение осциллятором MACD своей центральной линии не следует рассматривать как возможность для мгновенного открытия новой позиции.

На самом деле, данное утверждение действительно при использовании классических параметров MACD и общих теоретических положений при построении торговых систем на основе MACD, рекомендуемых авторами многочисленных книг по техническому анализу. В данной статье я постараюсь рассмотреть некоторые новые подходы в применении осциллятора MACD в ТС «Консервативный скальпинг intraday».

Итак, для чего нам нужен MACD? Безусловно, MACD помогает идентифицировать краткосрочное направление тренда на 10-минутных тайм-фрейме на участках трендовой группы, когда определение тренда с помощью EMA не всегда бывает эффективным решением. При этом не редко встречаются ситуации, когда импульс движения цены в одну сторону очень резко меняется на противоположный. Классический пример подобной ситуации наглядно проиллюстрирован на следующем графике – рис.1.:



Рис. 1. GBP/JPY. Смена участков рынка и изменение импульса движения цены после 07-00GMT.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй

В таких ситуациях, работа с использованием отбойных сигналов от EMA и сигналов Stochastics невозможна согласно правилам ТС «Консервативный скальпинг intraday». Попробуем решить данную проблему с применением осциллятора MACD в видоизменённой форме, отличающейся от классической работы с MACD, описанной в книге «Консервативный скальпинг intraday».

Во-первых, возьмём встроенный в программу технического анализа RUMUS 2 индикатор NewMACD, имеющий следующий нехитрый код:

```
n1 = inparam("Параметр быстрой средней", 1, 100, 5);
n2 = inparam("Параметр медленной средней", 1, 100, 34);
n3 = inparam("Параметр сигнальной средней", 1, 100, 5);
n4 = inparam("типсредней (1-s/2-e)", 1, 2, 1);
if n4=1 then
begin
NMACD=mov((h+l)/2,n1,s)-mov((h+l)/2,n2,s);
NMACD_S=mov(NMACD,n3,s);
end;
if n4=2 then
begin
NMACD=mov((h+l)/2,n1,e)-mov((h+l)/2,n2,e);
NMACD_S=mov(NMACD,n3,e);
end;
if NMACD>=ref(NMACD,-1) then gr=NMACD; else red=NMACD;
gr;
red;
NMACD;
NMACD_S;
0;
```

Данный код мало чем отличается от стандартного MACD, за исключением графического представления осциллятора и расчёта MA, но не по цене CLOSE, а используя среднее значение свечи, получаемое путём усреднения значений HIGH (H) и LOW (L) – т.е. (H+L)/2.

Параметры данного индикатора для валютной пары GBP/JPYвыберем следующие:

Быстрая линия – 36.
Медленная линия – 72.
Параметр сигнальной линии – 5.
Тип средней – 2 (EMA).

Логика установки данных параметров заключается в сравнении динамики движения цены за половину суток (72) и краткосрочного изменения цены за четверть суток (36) – 1 торговую сессию. В качестве границ уровней перекупленности / перепроданности рекомендуется установить границы 0.2 / -0.2 соответственно.

Работа с осциллятором NewMACD.

Будем считать, что смена краткосрочного трендового движения будет происходить при пересечении NewMACD своей центральной линии сверху вниз или снизу вверх, как это видно из рис. 2. При этом подобный сигнал осциллятора не будет являться достаточным условием для открытия позиции, а будет свидетельствовать только о ВОЗМОЖНОЙ смене тенденции.

Курс 2 Консервативный скальпинг интрадэй



Рис. 2. GBP/JPY. Тактика работы с осциллятором NewMACD.

Вход в рынок будет, как и всегда, согласно правилам ТС «Консервативный скальпинг intraday» будет осуществляться с использованием сигналов осциллятора Stochastics со стандартными параметрами – (13,5,3). На рис. 2. видно, что в точке №1 произошло изменение восходящей тенденции, складывающейся на протяжении нескольких предыдущих дней, на нисходящую тенденцию, но при этом сигналов на вход в рынок согласно базовым правилам ТС «Консервативный скальпинг intraday» не поступало.

В подобных случаях рекомендуется, дождавшись пересечения центральной линии, отследить разворот Stochastics в сторону направления движения NewMACD, в данном случае в нисходящем направлении. В точке №2 сформировалось пересечение линий Stochastics, и можно было открыть короткую позицию с уровня 205,11, с целью не более 50-60 пунктов и ордером stop-loss на последний локальный экстремум на свечке за 11-10GMT – 205,41 (с учётом спреда).

Отдельно хотелось бы обратить Ваше внимание, что при использовании данной тактики размеры ордеров take-profit/stop-loss, как правило, сравнимы со значениями коэффициента нормальной доходности $K_d = 1,0-1,2$ и ждать резкого и сильного импульса после пересечения центральной линии NewMACD не следует. Дальнейшее развитие событий Вы можете самостоятельно рассмотреть, загрузив данный график за 23.05.2008г.

Для работы в рамках предлагаемой тактики рекомендуется выбирать наиболее волатильные пары, которые дают длинные разнонаправленные ходы в течение нескольких дней.

Примечание: Настройка параметров осциллятора NewMACD для других валютных пар может отличаться.