



Пятый класс

Урок 1

Торговая система - состав и важные вопросы

Торговая система включает в себя некий **набор условий и правил**, определяющих моменты и порядок выполнения следующих действий:

- открытия длинной позиции;
- закрытия длинной позиции;
- открытия короткой позиции;
- закрытия короткой позиции.

Конструируя торговую систему, трейдер должен ответить на следующие вопросы:

- Какие валютные пары будут использоваться при проведении операций?
- Какой из методов анализа будет применяться? Технический, фундаментальный, комбинация технического и фундаментального?
 - Какие временные интервалы лучше подходят для создаваемой системы? Часовые, дневные....
 - Какими индикаторами будем пользоваться?
 - Принцип работы системы – по тренду, против тренда или в канале?
 - Будет ли использоваться графический метод технического анализа?
 - Будем ли мы использовать комбинации свечей (какие, как именно)?
 - Каким лотом вы намереваетесь работать? Собираетесь ли вы его менять по ходу торгов или же предпочтете работать с одной и той же величиной лота? Будут ли допускаться добавление, частичное закрытие и переворот?
- По каким правилам открывать и закрывать позиции? Какие конкретные критерии будут использоваться для вхождения на рынок или для выхода из него? Когда лучше открывать позиции? Когда эффективнее их закрыть?
 - Каким образом позиции будут сопровождаться?
 - Какие критерии выхода из позиции подходят для Вас: временные (например, через 20 дней или после окончания торговой сессии), по мере получения определенной прибыли или какие-то другие.
 - Сколько времени вы предпочитаете держать позицию?
 - Будут ли использоваться ордера, в частности, stop-loss?
 - Какой величины будет stop-loss?

Правила построения торговой системы

- Позитивное ожидание

Позитивное ожидание – это свойство системы быть в целом прибыльной на достаточно большом промежутке времени. Это свойство определяется не соотношением количества прибыльных и убыточных сделок (система может быть прибыльной и при малом количестве прибыльных сделок, если они высокодоходные), не соотношением размеров среднего убытка для всех убыточных сделок и средней прибыли для всех прибыльных (система может быть прибыльной и при малой средней прибыльности сделок, если прибыльных сделок много больше, чем убыточных), а тем фактом, что средняя прибыль от всех сделок за период тестирования больше нуля.

- Малое количество правил

Увеличение количества правил приводит к уменьшению количества тех убыточных сделок, которые поддающихся фильтрации, а также – к уменьшению количества прибыльных сделок. Но всегда есть такие убыточные сделки, которые никакими средствами не отфильтровать. В их основе – обычные неожиданности. Поэтому, излишнее увеличение количества правил приведет к уменьшению прибыльности системы.

- Устойчивость системы
- Варьирование торговых лотов
- Контроль риска, управление капиталом и диверсификация
- Механистичность системы
- Применимость системы

Урок 2.

Подход к определению суммы сделки (лота) и уровня стоп-ордера

Алгоритм действий по определению суммы сделки рассмотрен на примере.

Исходные условия:

- трейдер располагает депозитом в 800 долларов;
- предполагаемая валютная пара для торговли: GBP/USD.
- лимит убытка по одной сделке: 10% (как правило, данный показатель варьируется от 2% до 5% у консервативных трейдеров; кроме того, при работе с небольшим депозитом трейдер просто вынужден для проведения торгов прибегать к увеличению этого значения);

- следовательно, лимит убытка по одной сделке в долларах составляет \$80. (10% * 800 долларов).

Исходя из этого, можно составить таблицу, отражающую максимальный размер ордера стоп-лосс (ограничителя убытков) при конкретном лоте.

Лот	Вес 1 пункта, долларов	Максимальный стоп-лосс, пунктов.
0,01	1	80
0,02	2	40
0,03	3	26
0,04	4	20
0,05	5	16

Уровень ордера стоп-лосс определяется также в зависимости от применяемой методики прогноза. Человек не может быть прав в 100% случаев, тем более, когда речь идет о начинающем трейдере на рынке FOREX. Любое открытие позиции представляет собой гипотезу трейдера относительно будущего поведения рынка. И в некоторых случаях существует возможность определения уровня, движение до которого говорит об ошибочности данной гипотезы. Естественно, что если цены дошли до этого уровня, то держать позицию дальше и находиться в убытке нет смысла. Например, если трейдер использует для определения тренда положение о повышающихся экстремумах (для восходящего тренда – максимумы и минимумы повышаются), то пробой при откате уровня предыдущего минимума уже говорит о том, что восходящий тренд находится под вопросом.

Если же методика не позволяет определять уровень стоп-лосса исходя из самих же прогностических правил, то, как правило, ордер стоп-лосс ставится под ближайшие экстремумы.

Большое значение имеет и временной масштаб работы трейдера: работа по дневным графикам требует большего депозита и предполагает большие стоп-лоссы, чем при работе на часовых данных.

После определения по таблице лота и максимального размера стоп-лосса, трейдер замеряет расстояние в пунктах от предполагаемой котировки открытия позиции до уровня ордера стоп-лосс. Предположим, что в нашем примере оно составляет 38 пунктов. Для того чтобы при неблагоприятном развитии событий уложиться в максимальный лимит потерь по одной сделке, то есть в 80 долларов, трейдер должен соблюдать соответствие между размером стоп-лосса в пунктах и размером «разрешенного» лота (смотрите таблицу). В нашем примере при лимите потерь по одной сделке в \$80 и стоп-лоссе в 38 пунктов трейдер может использовать только лоты 0,01 и 0,02. Использование больших лотов (например, 0,03) приведет к тому, что трейдер увеличивает лимит риска в долларах. Подсчитаем размер риска при лоте 0,03: 38 (размер стоп-лосса) умножаем на \$3 (вес пункта при лоте 0,03) и получаем 114 долларов, что явно выше намеченного ранее уровня лимита потерь в 80 долларов.

При работе по нескольким валютным парам трейдер должен учитывать корреляцию их движений. Существует тесная взаимосвязь между валютными парами EUR/USD и USD/CHF. Следовательно, открыв длинную позицию по паре EUR/USD и короткую по паре USD/CHF трейдер фактически увеличивает риски вдвое. Также необходимо учитывать, что пары котируются относительно доллара и в целом рынок движется «за» или «против» доллара. Разница в движении проявляется в динамике кросс-курсов.

Урок 3.

Параметры эффективности торговых систем

Существует классический ряд параметров эффективности торговых систем. Казалось бы, если счет растет, то зачем нужно придумывать какие-то показатели, отражающие этот рост?

Дело в том, что по величине определенных показателей можно судить об устойчивости системы, даже не взглянув на кривую роста счета, а по другим - понять, например, как часто открываются позиции и каких больше - прибыльных или убыточных.

Параметры эффективности системы нужны трейдеру для того, чтобы можно было сравнить две или несколько систем между собой. По итогам сравнения трейдер получает возможность выбрать ту систему, которая более устойчива и более прибыльна (либо ту, которая подходит ему по иным критериям).

Как "недокументированное" следствие этой возможности - новая возможность: пользуясь параметрами эффективности, трейдер может описать свою систему другому трейдеру или потенциальному инвестору, не раскрывая ее основных принципов действия.

- Полученная (итоговая) прибыль P
- Валовая прибыль (сумма всех побед, $S(P_i)$)
- Валовой убыток (сумма всех поражений, $S(L_i)$)
- MIDD (максимальное падение кривой доходности, «максимальный внутридневной нарастающий убыток», maximum intraday drawdown)
- RF (фактор восстановления, restoration factor): $RF = P/MIDD$
- PF (профит фактор, profit factor, PF): $PF = S(P_i) / S(L_i)$
- APF (достоверный профит-фактор, actual profit factor) – это разница между валовой прибылью за исключением самого большого выигрыша и валового убытка): $APF = [S(P_i) - P_{max}] / S(L_i)$
- Общее количество совершенных сделок
- Количество прибыльных сделок
- Количество убыточных сделок
- Средний выигрыш
- Средний проигрыш
- Максимальный выигрыш
- Максимальный проигрыш
- Максимальное количество побед подряд
- Максимальное количество поражений подряд
- Минимальный депозит для работы по данной системе

Урок 4.

Как работать с приведенными торговыми системами

В этом разделе вашему вниманию предлагается ряд несложных торговых систем. Перечисленные системы частично принадлежат "перу" классиков, частично - известных "Форекс Клубу" трейдеров. Соответственно, в какие-то промежутки времени эти системы показывали хорошие результаты.

Предлагая эти системы вашему вниманию, мы настоятельно рекомендуем вам **не принимать все на веру**, а постараться приложить максимум усилий к тому, чтобы разобраться с каждой системой в отдельности и убедиться в ее работоспособности или неработоспособности.

Для этого, во-первых, внимательно изучите правила той системы, которую вы изучаете. Важно, чтобы вы четко понимали, в какие моменты производится открытие позиции, в какие - закрытие и как выставляются стоп-ордера или ордера на фиксацию прибыли. Перед тестированием системы проясните все неясности!

Затем пройдите "под руку с системой" по истории. Это нужно сделать вручную, так как только в этом случае вы почувствуете, что в ней хорошо, а что плохо. Для фиксации результатов ручного тестирования заведите себе файл в таблице Excel, куда заносите:

- дату и время сигнала на открытие позиции
- курс открытия позиции
- пояснения к открытию позиции
- уровень ордера stop-loss
- уровень ордера take-profit, если такой выставляется
- дату и время сигнала на закрытие позиции (или срабатывания ордера)
- курс закрытия позиции
- пояснения к закрытию позиции
- итог сделки (итог сделки = курс закрытия - курс открытия - спрэд)
- сальдо по счету (предыдущее сальдо + итог сделки)

При желании, вы можете обсудить системы с сокурсниками. Надеемся, что вы понимаете и наши коммерческие интересы, и сохраните этот интеллектуальный капитал для наших студентов, не вынося лишней раз эту информацию на внешние форумы. :)

Поскольку что-то новое с использованием стандартного набора индикаторов изобрести сейчас уже действительно сложно, системы могут быть в чем-то похожи друг на друга. Однако каждая из них имеет свои особенности, и эти особенности могут влиять на доходность.

Мы намеренно не даем информации о доходности систем: тестирование систем считайте вашим домашним заданием. Более того, мы не будем проверять, выполнили ли вы задание или нет. Хочется, чтобы вы уже начали работать **НА СВОИ ИНТЕРЕСЫ**.

Успехов!

Система «Три средние + MACD»

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система «Три средние + MACD»

Автор Федоров А., г. Владивосток

Рабочий интервал: часы.

Идея: отслеживание тренда по средним SMA-120 и SMA-24; идентификация коридора по вхождению SMA-24 в зону SMA-60/SMA-120 (линии путаются), открытие по пересечению линий MACD.

Инструменты: средние SMA-120, SMA-24, SMA-60, MACD-12/24/6.

Система описана в пособии по курсу, раздел 3.7.

Система "Три экрана"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "Три экрана"

Автор: Элдер А.

Рабочий интервал: дни.

Идея: открытие позиции в направлении масштабного тренда в момент завершения коррекции в основной (нормальной) временной структуре, о чем трейдеру скажет резкий толчок цены в направлении тренда в момент окончания коррекции.

Инструменты:

1. недельный график – MACD-гистограмма,
2. дневной график – Stochastic или RSI

Одновременно ведется наблюдение в трех временных структурах:

- Нормальная временная структура (НВС) – дни;
- повышенная временная структура (ВВС) – недели;
- пониженная (ПНВС) – часы.

Работа по системе

1. Первый экран – MACD-гистограмма на ВВС. Определяет главную тенденцию. Соответственно, сигналы на более низкой НВС должны соответствовать по направлению тренду ВВС.

a. Если гистограмма повышается (даже если она еще ниже нуля), рассматриваем только сигналы на покупку. Если гистограмма поднялась выше нулевой линии, то сигналы на покупку в рамках НВС становятся еще сильнее.

b. Если гистограмма снижается (даже если она выше нуля), рассматриваем только сигналы на продажу. Если же гистограмма опустилась ниже нулевой линии, то сигналы на продажу в структуре НВС становятся еще сильнее.

2. Второй экран – Stochastic и/или RSI на НВС. С их помощью отслеживаем коррекционные движения «нормального» масштаба на фоне ВВС.

a. На покупку входим только в том случае, если тренд ВВС вверх, а осциллятор второго экрана выходит из зоны перепроданности и движется вверх. Фактически это означает, что закончилась коррекция и продолжилось движение в направлении тренда ВВС.

b. На продажу работаем только в том случае, если на ВВС тренд вниз и одновременно на НВС осциллятор подтвердил разворот цены после коррекции в направлении тренда ВВС, то есть вниз.

3. Третий экран – прорывы ценой экстремумов предыдущего дня в направлении тренда ВВС и при условии завершения коррекции в НВС. Третий экран помогает эффективно использовать краткосрочные колебания цены для обнаружения момента окончания коррекции в НВС.

a. Если на ВВС тренд направлен вверх, если в НВС осцилляторы находятся в зоне перепроданности (то есть, завершается коррекция вниз) и если в течение сегодняшнего дня цена прорвала максимум предыдущего дня (коррекция вниз на дневном графике, видимо, завершилась!), покупаем.

b. Если на ВВС тренд направлен вниз, если в НВС осцилляторы находятся в зоне перекупленности (то есть, завершается коррекция цены вверх) и если в течение сегодняшнего дня цена прорвала минимум предыдущего дня (коррекция вверх, видимо, завершилась!), продаем.

Варианты работы:

- осторожный вариант: держать позиции открытыми до завершения недельной тенденции.
- агрессивный вариант: добавление по окончанию каждой новой коррекции на НВС.

Защитные стопы размещаются:

- ниже минимума сегодняшнего или вчерашнего дня, если совершена покупка;
- выше максимума сегодняшнего или вчерашнего дня, если совершена продажа.

Система "Биржевой рентген" ("Луч Элдера")

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "Биржевой рентген" ("Луч Элдера")

Автор: Элдер А.

Прототип: система «Три экрана», но работа идет в единственной временной структуре.

Рабочий интервал (НВС): дни.

Идея: найти на фоне межвежнего тренда бычий бросок (бычьей коррекцию) и открыться вниз; соответственно, на фоне бычьего тренда найти медвежью коррекцию и открыться вверх.

Инструменты: на дневном графике EMA(13), индикатор силы быков BULLS(13), индикатор силы медведей BEARS(13).

Основополагающие принципы системы:

- текущая цена является согласованной тремя сторонами: быками, медведями и свободными трейдерами;
- максимум силы быков характеризуется максимальной ценой за последний интервал (High);
- максимум силы медведей характеризуется минимальной ценой за последний интервал (Low).

Экраны системы (области на экране НВС):

1. Первая панель – EMA(13) на графике цены. Сам график не рассматривается – наблюдаем за наклоном EMA.
 - a. Если EMA растет, считаем, что тренд бычий.
 - b. Если EMA падает, считаем, что тренд медвежий.

Период 13 предложен Элдером. Кияница А.С. предлагает брать больший период, то есть хотя бы 21, так как эта цифра лучше выдерживает коррекции с точки зрения того условия, что мы работаем в сторону наклона средней. Средняя с периодом 13 слишком быстро меняет наклон, внося суматоху и фактически дублируя сигналы двух описанных ниже индикаторов о том, что идет коррекция.

2. Вторая область экрана – индикатор силы быков:

$BULLS = High - EMA$

Сила быков велика и тренд считается бычьим, когда индикатор $BULLS > 0$, то есть $High > EMA$. Иначе сила быков мала.

3. Третья область экрана – индикатор силы медведей:

$BEARS = Low - EMA$

Сила медведей велика и тренд считается медвежьим, когда индикатор $BEARS < 0$, то есть $Low < EMA$. Иначе считаем, что медведи слабы.



Работа по системе:

1. Покупка производится тогда, когда EMA растет (тренд вверх), но при этом $BEARS < 0$, причем только-только началось его повышение в направлении тренда. Это говорит о том, что на фоне восходящего тренда медведи проявляли силу и производили коррекцию вниз, а точнее – уже завершили ее.

Лучшее время для покупки – тогда, когда на фоне растущей EMA индикатор BEARS быстро опустился ниже нуля и сразу же поднялся. Смысл этого в том, что сила быков очень велика, так как коррекция скоротечна, то есть это подтверждает силу восходящего тренда.

2. Продажа производится тогда, когда EMA падает (тренд вниз), но при этом $BULLS > 0$, то есть на фоне нисходящего тренда быки проявляли силу и производили коррекцию вверх. Продавать лучше по завершении коррекции, то есть когда BULLS начал опускаться в направлении тренда.

Лучшее время для продажи – тогда, когда на фоне падающей EMA индикатор BULLS быстро поднялся выше нуля, а затем сразу же упал ниже нулевой линии. Смысл этого в том, что коррекция невелика, реакция медведей оперативная и мощная – все это подтверждает силу нисходящего тренда.



3. Как видно, при растущей EMA мы наблюдаем за силой медведей BEARS, но BULLS не рассматриваем, а при падающей – за силой быков BULLS, но не принимаем ко вниманию BEARS. Все потому, что мы ищем лучшие моменты для входа, соответствующие завершению коррекций в направлении, противоположном тренду.

4. Сильным предвестником о возможной покупке является дивергенция между нисходящим графиком цены и силой медведей BEARS, имеющей отрицательные значения. Если обнаружится, что сформировался более низкий минимум цены, но очередной минимум силы медведей оказался выше предыдущего, возможен разворот вверх. Его подтвердит разворот EMA вверх. После этого следует найти момент для входа вверх по очередной медвежьей коррекции, как описано в пункте 1.

5. Сильным предвестником о возможной продаже является дивергенция между восходящим графиком цены и силой быков BULLS, имеющей положительные значения. Если обнаружится, что сформировался более высокий максимум цены, но очередной максимум силы быков оказался ниже предыдущего, возможен разворот вниз. Его подтвердит разворот EMA вниз. После этого следует найти момент для входа вниз по очередной бычьей коррекции, как описано в пункте 2.

Стоп-ордера:

Стоп-ордера ставятся по последнему экстремуму коррекции, после формирования которой произведен вход. Также можно ставить по экстремуму предшествовавшей коррекции, если величина стоп-ордера приемлема и рациональна

Система "По тренду"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "По тренду"

Прислал Ивонин В., г. Тюмень

Рабочий интервал: часы (нормальная ВС – часовой график, высшая ВС – дневной график).

Идея: по дневному графику по EMA-3x3 отслеживаем тренд, а по MACD или далее по RSI на часовом графике производим сделку.

Инструменты:

1. Дневной график.

- EMA с периодом 3 и сдвигом по оси X=3.
2. Часовой график.
- EMA с периодом 3 и сдвигом по оси X=3
 - MACD 12/120/5 (отстроена экспоненциально, по закрытию)
 - RSI 9 (без сглаживания, по закрытию)

Открытие позиции:

1. Анализ дневного графика
 - Если цена закрытия вчерашнего дня выше EMA – сделки только на покупку;
 - Если цена закрытия вчерашнего дня ниже EMA – сделки только на продажу;
2. Анализ часового графика

- Используем сигналы МАСД на покупку и продажу (только пересечение основной и сигнальной линий) в согласии с анализом дневного графика. После этого ждем сигнал на открытие позиции по RSI;
- При рассмотрении RSI используем только развороты кривой индикатора. Покупаем, если кривая RSI развернулась снизу вверх, продаем – если развернулась сверху вниз, что говорит об окончании коррекции.

Другие условия:

1. Цена при открытии позиции должна двигаться в сторону сделки (анализ свечей).
2. Риск должен соответствовать депозиту.
3. Стоп-лосс ставится по минимальной цене предыдущей свечи.

Закрытие позиции:

1. По срабатыванию ордера стоп-лосс.
2. По закрытию цены выше или ниже ЕМА на часовом графике.



Система "По развороту"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "По развороту"

Прислал Ивонин В., г. Тюмень

Рабочий интервал: часы (Нормальная ВС – часовой график)

Идея: сильный осциллятор MACD показывает значимые развороты цены, а слабый Stochastic – точки входа в этих разворотах.

Инструменты:

1. MACD-5/34/5 (экспоненциально, по закрытию)
2. Stochastic-8/3/3 (экспоненциально, по закрытию)
3. EMA с периодом 3 и сдвигом по оси X=3.

Открытие позиции:

- сигналы MACD на покупку и продажу (только пересечение основной и сигнальной линий);
- stochastic - сигналы на открытие позиции (только пересечение основной и сигнальной линий) в сторону сигналов MACD;

- движение цены в сторону открытия позиции (анализ свечей).

Другие условия:

- риск соответствует депозиту;
- стоп-лосс по минимальной цене предыдущей свечи.

Заккрытие позиции:

1. по срабатыванию ордера стоп-лосс;
2. по закрытию выше или ниже EMA.



Система "Опорные точки"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "Опорные точки"

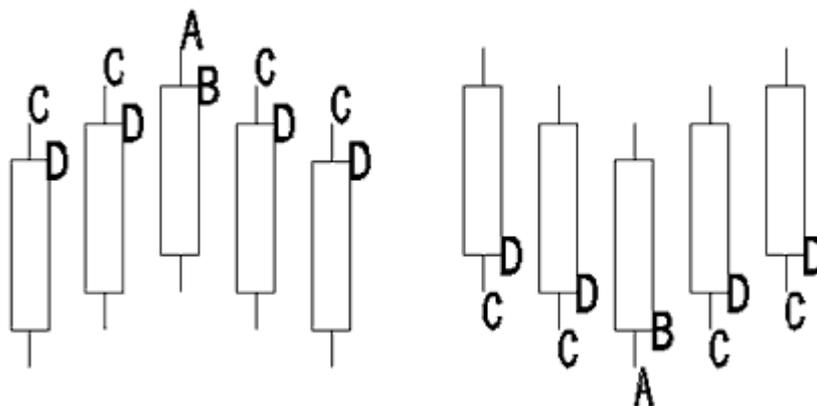
Прислал Стукалов Д., г. Самара

Рабочий интервал: дни.

Идея: использование опорных точек для расстановки ордеров на открытие и стоп-лосс ордеров.

Инструменты: технических индикаторов нет.

Модель опорной точки:



Модель состоит из пяти последовательно сформировавшихся свечей, любой формы, любого размера и любого цвета. Точка А считается опорной точкой или точкой абсолютного максимума (минимума) при соответствии модели одновременно двум обязательным условиям.

1. Значение цены в точке А больше (меньше) значения цены в любой из точек С одновременно;
2. Значение цены в точке В (край тела свечи) больше (меньше) значения цены в любой из точек D (край тела свечи) одновременно.

Выполнения никаких других условий не требуется, но эти два должны выполняться одновременно.

Правила торговой системы:

1. Система применяется на дневных свечах любой валютной пары.
2. Ордера на открытие позиций выставляются на опорные точки с фильтром в 1 пункт. При формировании новых опорных точек ордера переносятся.
3. В случае открытия позиции, ордер, установленный на противоположную опорную точку автоматически является S/L.

Комментарий Стукалова Д.:

В случае движение цены в сторону открытой позиции четыре свечи подряд либо переносится стоп-ордер и позиция добавляется, либо прибыль фиксируется.

Комментарий Кияницы А.:

Четыре свечи подряд на днях – это момент, близкий к началу коррекции или разворота. Я бы не добавлялся. Скорее – да, следует зафиксировать прибыль и вновь расставить ордера по опорным точкам (или хотя бы на единственную, соответствующую максимуму импульса), что позволит открыть позицию вновь в направлении сложившегося движения. Это мнение частное.

Система "МТС-1 / Средняя + Опорные точки"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "МТС-1 / Средняя + Опорные точки"

Прислал Стукалов Д., г. Самара

Временной интервал: дни

Идея: ждем пробоя средней с последующим разворотом к ней цены и отскоком от неё в направлении пробоя, расставляем ордера (на открытие и стоп-лосс) по опорным точкам.

Инструменты: SMA(42), простая скользящая средняя.

1. Валютная пара: евро.
2. Открытие позиции – ордер на открытие позиции выставляется на экстремум, сложившийся на графике цены в результате разворота на отскок после пробития средней, фильтр – 1 пункт.
3. S/L выставляется на ближайший противоположный экстремум с фильтром в 1 пункт, переносится при формировании нового экстремума с целью фиксации прибыли.
4. T/P не используется.

Система "МТС-2 / Четыре средних"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "МТС-2 / Четыре средних"

Прислал Стукалов Д., г. Самара

Временной интервал: часы

Идея: используются две пары скользящих средних; длинная пара показывает направление тренда, сигналом на открытие считается пресечение пары коротких средних в направлении тренда, указываемого парой длинных средних.

Инструменты: две пары скользящих средних с параметрами первой пары 160 и 80 и второй пары – 24 и 12.

1. Валютная пара – фунт.

2. Открытие позиции: ордер на открытие позиции выставляется

a. на экстремум цены, ближайший к точке пересечения коротких средних с фильтром 25 пунктов,

b. а в случае отсутствия такового – относительно текущей цены с фильтром 40 пунктов.

3. S/L выставляется на ближайший противоположный экстремум с фильтром в 25 пунктов, переносится

при формировании нового экстремума с целью фиксации прибыли.

4. T/P – не используется.

Система "МТС-3 / 2 средних + MACD"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "МТС-3 / 2 средних + MACD"

Прислал Стукалов Д., г. Самара

Временной интервал: часы.

Идея: пара скользящих средних показывает направление тренда, сигналом считается пресечение линий MACD в направлении тренда, указываемого парой средних.

Инструменты: пара скользящих средних с параметрами 160 и 80 и MACD-30/50/20.

1. Валютная пара – евро.

2. Открытие позиции:

a. ордер на открытие позиции выставляется на экстремум, ближайший к точке пересечения линий MACD с фильтром 25 пунктов,

b. а в случае отсутствия такового – относительно текущей цены с фильтром 40 пунктов.

3. S/L выставляется на ближайший противоположный экстремум с фильтром в 25 пунктов, переносится

при формировании нового экстремума с целью фиксации прибыли.

4. T/P – не используется.

Система "МТС-4 / 2 средних + RSI"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "МТС-4 / 2 средних + RSI"

Прислал Стукалов Д., г. Самара

Временной интервал: час.

Идея: пара скользящих средних показывает направление тренда, а сигналом на совершение сделки считается выход RSI из зон перекупленности (70%) или перепроданности (30%), либо пересечение индикатором RSI средней линии (50%) при условии, что эти сигналы совпадают с направлением тренда, указываемого парой средних.

Инструменты: пара скользящих средних с параметрами 160 и 80 и RSI(24,10).

1. Валютная пара – фунт/иена.

2. Открытие позиции: ордер на открытие позиции выставляется

a. на экстремум, сложившийся на графике цены, ближайший к точке пересечения RSI с одной из средних линий с фильтром 40 пунктов,

b. а в случае отсутствия такового – относительно текущей цены с фильтром 70 пунктов.

3. S/L выставляется на ближайший противоположный экстремум с фильтром в 70 пунктов, переносится

при формировании нового экстремума с целью фиксации прибыли.

4. T/P не используется.

Система "RAVI + Stochastics"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "RAVI + Stochastics"

Прислал Сафин В.И., г. Москва

Временной интервал: часы.

Идея: по RAVI или PriceOscillator-у отслеживаем тренд и входим в направлении тренда после окончания коррекции по сигналу Stochastic.

Инструменты:

1. RAVI или Price-Oscillator с параметрами 12/72.
2. Stochastic(6,2,1)

Открытие позиции

1. Ждем, когда RAVI покажет, что на рынке сложился тренд. В примере тренд – нисходящий, так как RAVI падает ниже сигнальной линии «-0.30».

2. После первого разворота осциллятора Stochastic в направлении тренда открываем позицию.

Закрытие: по стоп-ордеру.

Стоп-ордера

1. S/L ставим на последний экстремум цены. Передвигаем на очередной экстремум вслед за ценой.
2. T/P не используем.



Система "Три индикатора"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "Три индикатора"

Автор: Б. Уильямс («Торговый Хаос»), откорректирована неизвестным солдатом, прислал Сафин В.И., г. Москва
Временной интервал: час.

Идея:

Инструменты:

1. MACD(5,34,5), но не по ценам закрытия, а по средним значениям (на часах можно и по ценам закрытия);

Три скользящих средних с параметрами 5, 13, 34 – как подтверждение сигналов MACD; также – свечные комбинации;

2. MFI – индекс облегчения рынка, $MFI = \text{Range}(\text{High} - \text{Low}) / \text{Volume}$
3. Объемы

Работа по системе

Открытие позиции:

1. Ждем того времени, когда:

- гистограмма поднимается выше линии, то есть наступает период покупки,
- или когда опускается ниже линии – наступает период продажи.

2. Желательно получить подтверждение направления тренда с помощью скользящих средних 5, 13, 34.

Пока 5-периодная средняя выше 13 и 34-периодной – мы покупаем, если ниже – продаем.

По непроверенной информации от неизвестного солдата при использовании средних для подтверждения большинство сигналов будет пропускаться, хотя резко возрастет надежность остающихся – примерно до 90%. Вместо средних для повышения надежности неизвестный солдат использует индикатор Ишимоку Кинко Хё. «Система трех

индикаторов» обеспечивают надежность 70 на 30, если нет свечных и фундаментальных противопоказаний, а индикатор Ишимоку – где-то 80 на 20.

3. Дополнительным подтверждением служат свечи и их комбинации во всей своей полноте. Предложенный Уильямсом «фрактал» фактически является частным случаем широкого спектра свечных комбинаций.

4. Если последний сформировавшийся бар имеет больший объем Volume и большее значение MFI, чем предыдущий, то можно открыть позицию по направлению текущего бара и, естественно, по направлению тренда.

5. Если, объем растет, а MFI падает, то часто это показывает на возможный разворот, в особенности, если нарисовалась свеча Доджи.

Закрытие позиции:

1. По достижению Цели
2. По стоп-ордеру

Ордера:

1. S/L при входе в рынок ставим выше второго бара более высокого периода (на 1 минутках – более высокими являются 5-минутки, на 5 минутках – 3-минутки, на часовках – дневные бары, на днях – недельные).
2. Цель T/P надо рассчитывать.

Как правило, при внутридневной торговле неизвестный солдат рекомендует клиентам Цель1 по франку 50-60 пунктов, Цель2 – 100-120, со стоп-лоссом 30-40 пипс.

При дневной торговле по фунту ставит стоп-лосс около 100 пунктов, Цель1 – около 300, вторая – около 500 пунктов (она, правда, не часто достигается, ибо идет закрытие по трейлинг-стопу).



Система "Ловля коррекции по средним на БТР"

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Система "Ловля коррекции по средним на БТР"

Автор: Райан Джонс («Сделай миллион – играя числами»), откорректирована Кияницей А.С., прислал Кияница А.С., г. Москва

Временной интервал: дни.

Идея: ловим коррекцию с помощью системы средних, фильтруем момент входа по сглаженному осциллятору Бестрендовости

Результативность: с середины 1999 года по середину 2004 – 4600 пунктов, т.е. около 900 пунктов в год

Инструменты:

1. Скользящая средняя SMA-X (X=18 – по оптимизации, но можно привязаться к длине месяца – 22)
2. Сдвинутая скользящая средняя DSMA-X/Y (Y – 5-7 дней)
3. Сглаженный осциллятор Бестрендовости (BTR, в данном случае, отличается своей сглаженностью от более примитивного брата из книжки "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги")

- p1= Inparam("Period",1,100,22);
- p2= Inparam("Sdvg",1,100,22);
- btr=C-Ref(Mov(C,p1,S),-p2);
- btr=Mov(btr,22,S);
- btr;
- 0;

Работа по системе:

Открытие позиции

Long:

1. SMA-X больше, чем DSMA-X/Y – это говорит о существовании тренда вверх
2. C (close) меньше, чем C, бывшее Y дней назад – это говорит о наличии коррекции вниз
3. C больше, чем C, бывшее X+Y дней назад – это подтверждает наличие тренда
4. BTR > L (L=+0.005 для евро – подтверждается наличие тренда (кривая капитала становится более

гладкой))

Short:

1. SMA-X меньше, чем DSMA-X/Y – это говорит о существовании тренда вниз
2. C больше, чем C, бывшее Y дней назад – это говорит о наличии коррекции вверх
3. C меньше, чем C, бывшее X+Y дней назад – это подтверждает наличие тренда
4. BTR < L (L=- 0.005 для евро – подтверждается наличие тренда (кривая капитала становится более

гладкой))

Закрытие позиции – в момент переворота или по T/P.

Стоп-ордера:

1. T/P – 500 пунктов по евро
2. S/L – 100 пунктов по евро



Торговая система для работы в коридоре

Данная система описана в пособии по курсу "Анализ финансовых рынков и торговля финансовыми активами"

Пример построения системы на основе индикатора ценового канала

"Отказ от ответственности": Академия не несет ни материальной, ни моральной ответственности за убытки или иные нежелательные последствия, возникшие в связи с использованием кем-либо любым возможным образом приведенных на ее сайте торговых систем. Вся ответственность лежит на лице, принявшем решение об использовании данной системы в целях, интересующих его или его партнеров.

Индикатор Price Channel (PC) показывает наивысший максимум и наименьший минимум за определенный период времени.

Практическое использование индикатора может базироваться на том, что РС фактически позволяет формализовать определение уровней того или иного тайм-фрейма. Таким образом, пробой линии индикатора может являться сигналом на открытие позиции.

Линии РС также удобны в качестве ориентиров для сопровождения позиции методом скользящего стопа. При этом стоп-ордер может вестись по «ступенькам» индикатора.

В качестве примера использования данного индикатора рассмотрим следующие принципы открытия позиции, ее сопровождения и закрытия (на примере евро/доллар, данные с 1997 по 2005 года, дневные бары).

Используемые ценовые каналы: РС с периодом N1 и РС с периодом N2, причем $N1 > N2$.

Открытие длинной позиции: хай дневного бара выше вчерашнего РС (N1).

Закрытие длинной позиции: лоу дневного бара ниже вчерашнего РС(N2).

Открытие короткой позиции: лоу дневного бара ниже вчерашнего РС(N1).

Закрытие короткой позиции: хай дневного бара выше вчерашнего РС(N2).

В качестве значений N1 и N2 возьмем следующие параметры:

N1 = 65 (квартальный ценовой канал).

N2 = 22 (месячный ценовой канал)

Тестирование дало следующие результаты:

Валовый доход: +5707 пунктов

Валовый убыток: - 2287 пунктов

Профит-фактор: 2,49

Чистая прибыль (по закрытым позициям): +3420 пунктов

МИДД: 1100 пунктов

Фактор восстановления: 3,11

Чистая прибыль (с учетом текущей позиции): +4173 пункта

Количество закрытых позиций: 24

Средняя прибыль за сделку: +143 пункта

Средний плюс: +476 пункта

Средний лосс: -191 пункта

Наибольший плюс: +1042 пункта

Наибольший лосс: -498 пункта

Наибольшее число прибыльных сделок подряд: 5

Наибольшее число убыточных сделок подряд: 3

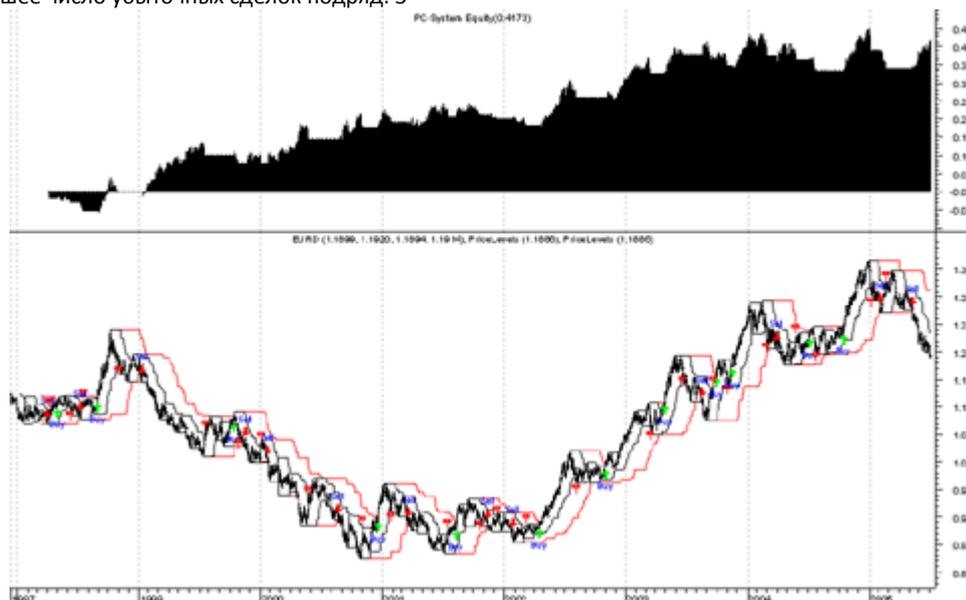


Рисунок 1 – кривая доходности (верхняя часть графика).

Обратите внимание, что период тестирования охватывает порядка семи лет. Если принять МИДД за размер депозита (1100 долл. в расчете на минимальный лот), то общая прибыль составляет порядка 310% или примерно 44% годовых (в среднем). При этом степень «загруженности» трейдера минимальна – сделки являются долгосрочными и не требуют ежедневного мониторинга.

Основные способы сопровождения и закрытия позиций

Вне зависимости от принципов открытия позиции, основные методические подходы по ее сопровождению и выходу из нее можно представить следующим образом:

I. Сопровождение позиции методом скользящего стопа

Основной принцип – спустя некоторое время и после некоторого движения цены в направлении позиции стоп-лосс трейдер начинает передвигать стоп-лосс по направлению открытой позиции. Задача заключается в четком формулировании критериев на изменение стоп-лосса. В качестве данных критериев могут выступать:

А) Инструменты графического анализа:

- Линии тренда.
- Локальные экстремумы.

На рисунке 1 представлен дневной график евро/доллар, отмечена точка открытия позиции на пробой уровня поддержки и указан уровень стоп-лосса. В дальнейшем сопровождение позиции может осуществляться по локальным экстремумам (отмечены горизонтальными синими черточками) или по линиям тренда (отмечены цифрами «1» и «2»). Обратите внимание, что тренд может ускоряться, что потребует перехода к более крутой линии тренда как ориентира для сопровождения позиции. Стоп-лосс выставляется чуть выше локального экстремума или линии.



Рисунок 1. Евро/доллар, дневной график

Б) Инструменты математического анализа:

- Скользящие средние.
- Ценовой канал.
- Параболика.
- Линии Тенкан и Киджун индикатора Ишимоку.

На рисунке 2 представлен все тот же отрезок дневного графика с аналогичным уровнем открытия позиции. Однако сопровождение позиции осуществляется по уровню ценового канала (Price Channel) с периодом 10, что соответствует значимым экстремумам за последние 10 дней. Отмечены два варианта первичной установки стоп-лосса: один – за ближайшим локальным экстремумом, другой – за уровнем 10-дневного ценового канала. Стоп-лосс передвигается только в том случае, если ценовой канал рисует своего рода «площадку», то есть идет горизонтально на протяжении нескольких дней (данные уровни отмечены синими горизонтальными черточками).

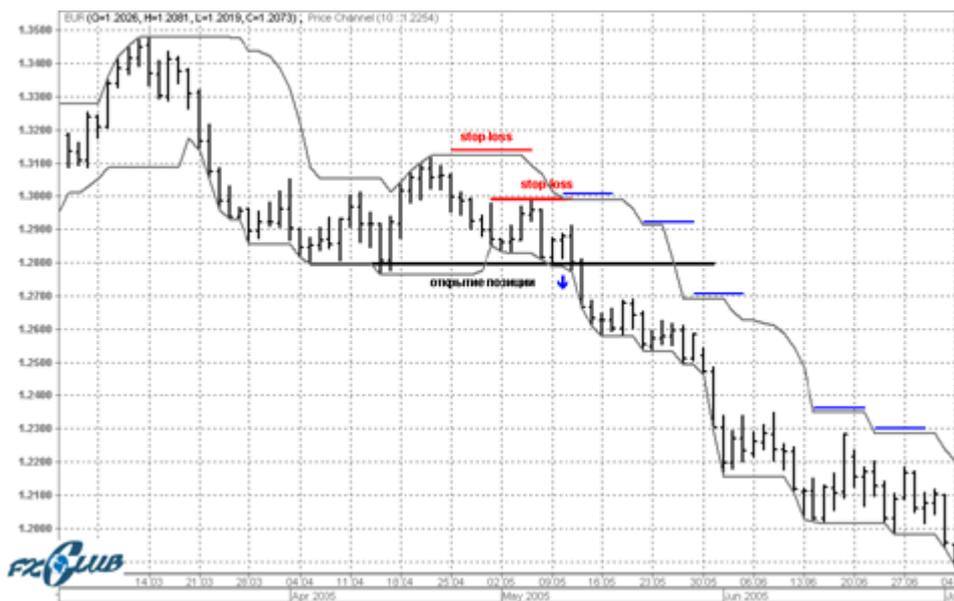


Рисунок 2. Евро/доллар, дневной график.

На 3 рисунке на тот же отрезок графика нанесена 22-периодная (месячная) скользящая средняя, уровень которой и служит ориентиром для изменения стоп-лосса по направлению движения позиции. Стоп-лосс при этом ставится чуть выше скользящей средней.

На 4 рисунке наложен индикатор Ишимоку с классическими размерностями 9, 26 и 52, ряд линий которого (тенкан-сен и киджун-сен) могут быть использованы как ориентиры для передвигки стоп-лосса по ходу позиции.



Рисунок 3. Евро/доллар, дневной график



Рисунок 4. Евро/доллар, дневной график

В) Сопровождение позиции методом кратного R.

Сопровождение позиции методом скользящего стопа по прохождению рынком размера первоначального риска (R). Открыли позицию, замеряем размер первоначального риска. От котировки открытия по ходу позиции откладываем «цели», цель 1 = риску, цель 2 = 2*риск и т.д. Если рынок доходит до цели один, стоп в паритет, если до цели 2, то на уровень цели 1 и т.д.

Данный принцип показан на рисунке 5.

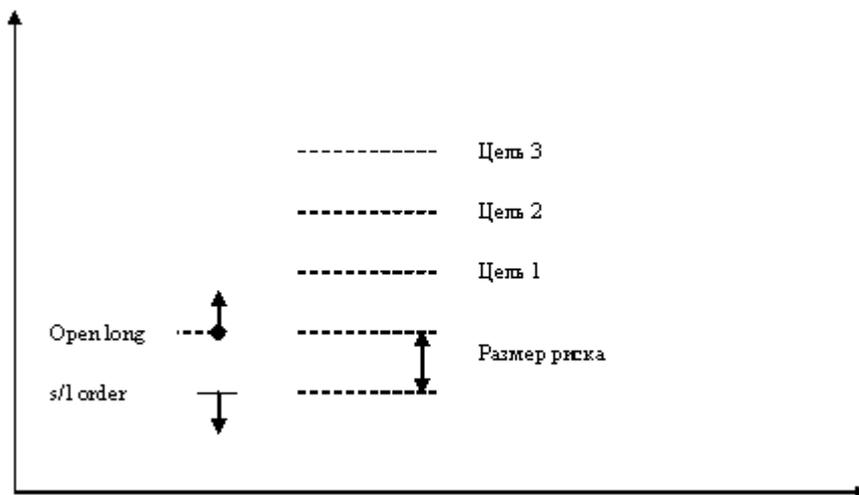


Рисунок 5. Принцип сопровождения позиции методом кратного R

Если трейдер использует расчет размера стоп-лосса с учетом лимита в процентах от депозита, то данный принцип сопровождения позиции можно дополнить следующими выводами. Допустим, что стоп-лосс равен 5% от депозита. Тогда на уровне цели 1 доходность будет составлять +5%, цели 2 - +10%, и на уровне цели 3 - +15%. Тогда если рынок достигнет цели 1, то первоначальный риск равен нулю (стоп в паритете), балансовый равен 5% (текущая прибыль); на уровне цели 2 защищенная прибыль равна +5%, балансовый риск равен 5% и т.д.

На рисунке 6 данный принцип проиллюстрирован на примере короткой позиции по евро/доллар.



Рисунок 6. Евро/доллар, дневной график

Г) Сопровождение позиции при проходе рынком определенного количества пунктов.

Задача сводится к выбору некоторого размера движения цены в пунктах (иногда – в процентах), при прохождении которого стоп-лосс переносится в паритет. Дальнейшее сопровождение может осуществляться по принципу кратного R, только в качестве R выступает выбранный размер движения цены.

II. Установка тейк-профитов

Тейк-профит закрывает позицию полностью или частично при достижении рынком какого-либо ориентира, когда позиция становится прибыльной. Тогда задача трейдера – четко и объективно сформулировать критерии расчета цены тейк-профита.

А) Инструменты графического анализа:

- Уровни, проводимые через локальные (значимые) экстремумы.
- Целевые ориентиры, вычисляемые на основе пропорций Фибоначчи.
- Противоположная линия канала.

На рисунке 7 представлен пример с определением значимых уровней как целевых ориентиров для движения цены.



Рисунок 7. Евро/доллар, дневной график

Б) Установка тейк-профита на целях, определяемых методом кратного R.

Если статистически подтверждено, что по системе цена часто достигает целей 1 и 2, то тогда целесообразно на уровне цели 1 производить частичное закрытие позиции (с параллельным переносом стоп-лосса в паритет) и окончательным выходом по тейк-профиту на уровне цели 2. При этом первоначальное открытие позиции должно осуществляться как минимум двумя лотами.



Рисунок 8. Евро/доллар, дневной график

В) Установка тейк-профита на фиксированном расстоянии от котировки открытия.

Данный метод аналогичен методу кратного R, однако выбираемое фиксированное расстояние отлично от размера стоп-лосса.

III. Генерация противоположного сигнала

Выход из позиции осуществляется при поступлении противоположного сигнала, переворот позиции производится с рынка или по ордеру (в зависимости от принципов открытия позиции).

IV. Прохождение определенного периода времени

Например, позиция по внутридневной системе торгов может быть закрыта с окончанием торгов в каком-либо финансовом центре (например, Лондоне, на который приходится б`ольшая часть торгового оборота на FX) или по окончанию какой-либо торговой сессии.

Также выход может осуществляться, если в течение определенного периода времени (или к окончанию определенной торговой сессии) на рынке не происходит какого-либо существенного движения обменных курсов.

V. Комбинация предыдущих подходов

Включает в себя комбинации приведенных выше подходов. Например, открытие позиции тройным лотом с установкой тейк-профитов на уровнях целей 1 и 2 (определяются по принципу кратного R) и параллельным сопровождением позиции скользящим стопом (R-критерий).

Принципы доливки к открытой позиции

Сопровождение позиции: доливка (первоначальный и балансовый риск)

Когда позиция открыта, могут поступать повторные сигналы в том же направлении. В данном случае трейдер может выполнить операцию по доливке, то есть, увеличив лот.

Доливка изменяет котировку открытия позиции, приближая ее ближе к текущему рынку. Делая доливку в данном случае необходимо до доливки и после нее иметь балансовый риск, но никак не оказаться в ситуации, когда после доливки уровень стоп-приказа будет означать приказ типа стоп-лосс.

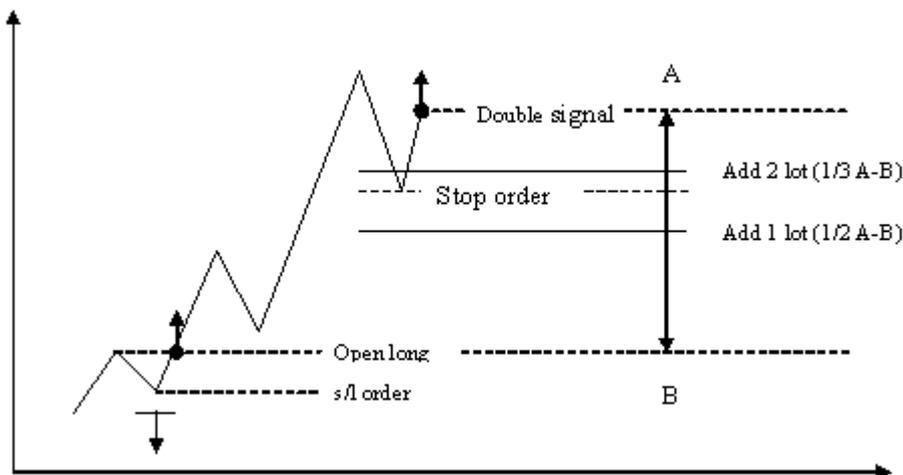


Рисунок 1.

Рассмотрим данную ситуацию на примере (рисунок 1).

Допустим, была открыта длинная позиция лотом 0,01 с уровня, отмеченного как «open long». Рынок действительно пошел в сторону, прогнозируемую трейдером. Например, спустя некоторое время и некоторый ход цены поступает повторный сигнал (уровень «Double signal»). К этому моменту трейдер потенциально может перенести стоп-ордер под ближайший локальный минимум («Stop order») [классический способ передвижки стопа по локальным экстремумам]. К моменту поступления второго сигнала рынок прошел расстояние A-B. Удвоение лота (то есть, покупка на 0,01) приведет к тому, что котировка открытия позиции сместится примерно на середину отрезка A-B. Утроение лота (то есть, покупка 0,02) приведет к тому, что котировка открытия суммарной (утроенной) позиции сместится примерно на треть этого отрезка (естественно, ближе к текущим котировкам). Как было отмечено выше, приемлем вариант, когда позиция после доливки будет иметь балансированный риск, но никак не первоначальный. Следовательно, трейдер не сможет утроить лот.

**Примечание: утроение лота возможно, если размер первоначального риска по утроенной позиции будет вписываться в лимиты, установленные трейдером (риск на 1 сделку).*

NEW! - Визуальное определение МИДДа на кривой доходности

Определение МИДДа

Расчет МИДД при «ручном тестировании» удобно производить с помощью программы MSExcel. Гистограммой отложены результаты конкретных операций, а кривая воспроизводит накопленный результат. Самая глубокая яма наращенной кривой доходности и является МИДДом. Обратите внимание, что после первого падения (точка 9 на оси X) кривая поднимается вверх, но все равно опускается ниже. То есть, МИДД образован не как серия убыточных операций, а как серия прибыльных и убыточных операций с перевесом в пользу убытка.

