

Добрый день!

Сегодня я расскажу вам весьма занимательную торговую тактику. Слово стратегия здесь не подходит, т.к. Стратегия ставит цели, а тактика их непосредственно достигает.

Итак, поставим стратегическую цель: ловить разворот рынка

1. При смене тенденции
2. При коррекционном движении.

Это стратегия. Как теперь воплотить её в жизнь?

В архиве «Курилки» за 2008 год можно найти два полезных материала (<http://www.igyudin.ucoz.com/Smooker/Allfiles.pdf>), которые помогут нам разобраться в работе торговой тактики, которую я назвал «Ищейка». Ищейка потому что она сама будет искать точки разворота графика.

Для реализации задуманного нам понадобится:

- a. Система, показывающая направление возможного разворота
- b. Инструмент, реализующий вход в рынок при обнаружении разворота.

Для реализации пункта а., нужен индикатор ТА, показывающий направление движения цены. Его задача указать СЛОЖИВШЕЕСЯ движение. Разумеется в масштабе того тайм-фрейма, на котором Вы работаете. Повторю, нам нужно только направление!

Для реализации входа при развороте потребуется обыкновенный ордер тейк-профит (ТП), стандартный в QUIK. В ссылке есть занятие, посвященное установке ТП и описание его работы. ТП имеет 3 параметра: условие активации заявки (УАЗ), отступ и защитный спрэд (ЗС). Главное качество этого ордера в том, что он выставляет лимитированную заявку при уменьшении достигнутого финансового результата по позиции, не взирая на уровень цены, при котором это уменьшение было достигнуто.

Итак, войска расставлены, начинаем воевать!

Допустим, что рынок идет вниз. Мы хотим отловить момент разворота вверх.

По индикатору определяем движение, например Williams(10) разворачивается из перекупленности вниз, пересекает -50%. Мы понимаем, что идет устойчивое движение вниз. Выставляется ТП на ПОКУПКУ. Где ордер активируется не важно, поэтому этот параметр произволен, надо лишь помнить, что активация ТП на покупку происходит:

- 1) по цене НИЖЕ УАЗ
- 2) на продажу ВЫШЕ УАЗ

поэтому в первом случае задавайте УАЗ выше текущей цены, а во втором случае ниже.

И так еще раз. Рынок идет вниз, мы ловим разворот вверх. Назначаем отступ больше малых коррекций на сформированном понижательном движении, мы настраиваем наш ТП на поимку сильного противоположного движения: на глубокую коррекцию или разворот. Задавая УАЗ выше текущей цены мы достигаем того, что ордер сразу активизируется. Если при этом поставить срок действия ордера «до отмены», то можно смело идти гулять. Ордер сам определит дно и выставит лимитированную заявку. Как определить уровень цены этой заявки?

Ордер исполняется так:

*после достижения ценой последней сделки условия активации заявки (УАЗ) начинается определение ПОСЛЕДНЕГО МАКСИМУМА(МИНИМУМА) ПОСЛЕ ДОСТИЖЕНИЯ ЖЕЛАЕМОГО УРОВНЯ ЦЕНЫ – условия активации заявки.*

*После нахождения МАКСИМУМА(МИНИМУМА) рассчитывается уровень МАКСИМУМ - ТЕКУЩАЯ ЦЕНА для ПРОДАЖИ, или ТЕКУЩАЯ ЦЕНА - МИНИМУМ для ПОКУПКИ*

*Если разница по п. 2 равна ОТСТУП, то генерируется ЛИМИТИРОВАННАЯ заявка по цене:*

*Цена последней сделки – ЗАЩИТНЫЙ СПРЭД для ПРОДАЖИ*

*Цена последней сделки + ЗАЩИТНЫЙ СПРЭД для ПОКУПКИ*

Если ЗС выбрать большим, т.е. равным разнице между котировкой и краем стакана, то лимитированная заявка исполнится как рыночная, т.е. СРАЗУ.

Ключевым параметром ТП является отступ. Его размер определяет масштаб движения, который ТП поймает. Если Вы настроены ловить длинные тренды, то берите отступ таким, что бы он был больше промежуточных коррекций на движении, которое Вы хотите поймать. Т.е. Если Вы хотите поймать тренд в 10 рублей, а коррекция на тренде составляет 1 руб., то отступ нужно брать 1,1 руб. с некоторым запасом.

Выходить из позиции можно по разному. Я приведу пример своего выхода.

После открытия позиции я выставляю ТП в противоположном направлении с тем же отступом, что предыдущий ТП. Или с другим, НО это нужно обосновывать! Если отступ всегда одинаков, то тут работает принцип симметрии: волатильность при движении вверх и вниз примерно равна. Выход из позиции опять-таки происходит без меня при развороте рынка или при глубокой коррекции. Эдакий «Кибернетик-Эксперт-Сорос-Ниддерхоффер».

Теперь тонкости.

- 1) Помните, что ТП рассчитывает отступ от того экстремума цены, который был ПОСЛЕ активизации ордера, т.е. если ВЫ хотите ловить дно и макушку графика, то выставляйте ордер ДО РАЗВОРОТА, т.е. на ПОКУПКУ, когда рынок еще движется вниз, а на ПРОДАЖУ, когда рынок все еще идет вверх. Иначе Вы не поймаете дно и будете входить уже на движении.
- 2) Будьте предельно внимательны при выборе размера отступа, т.к. при ошибках вместо прибылей будете получать убытки.
- 3) Ищейка рассчитана на графики с УСТОЙЧИВЫМ значением волатильности. Иначе будут происходить постоянные срабатывания на «шпильках» с самыми печальными последствиями. Т.е. Наилучшие результаты на гладких графиках типа Фьючерс SiXX 15 мин, Сугрут 60 мин, Лукойл 60 мин.
- 4) Ищейка предельно нетребовательна к анализу рынка, т.к. требует лишь определения ТЕКУЩЕГО направления движения, разворот она найдет сама, но согласно п. 1 желательно не допускать задержек входа, поэтому, на мой взгляд, лучше использовать осцилляторы, т.к. они не запаздывают. В этом отношении Williams самый лучший.
- 5) Так как Ищейка сама совершает все действия по входу в рынок, то момент сделки нам неизвестен заранее. Отсюда удобнее всего ставить срок действия ордера «до отмены», но помня, что она работает на графиках с устойчивой волатильностью, то её лучше отключать перед началом основной и дополнительных сессий, т.к. волатильность при их открытии сильно высока.

Собственно все. К занятию будут приложены иллюстрации.

Просьба ко всем, кто решит воспользоваться Ищейкой, пишите о результатах и деталях её работы мне на сайт <http://igyudin.ucoz.com> обсудим результаты.