



Переведено для трейдинг портала Tlap.com

Революция торговли на пробоях

Одна проверенная торговая формула, бесконечное количество стратегий и способы достижения максимальной свободы в трейдинге

Часть I

Революция

Только что началась революция.

Был тёмный вечер 17 ноября 1989 года. Прага, столица Чехословакии, крошечной страны в самом сердце Европы, проживала очередной типичный день коммунистического режима. Этот день был довольно серым. Большинство жителей, называемых «товарищами», уже вернулись домой со своей повседневной работы. Работа после 16:00 считалась чем-то довольно нетипичным, и даже обычная прогулка по улицам в конце дня могла считаться подозрительной деятельностью для вездесущей тайной полиции.

Единственные два доступных телеканала, называемые «СТ1» и «СТ2», в значительной степени контролируемые Коммунистической партией, транслировали типичное пропагандистское дерьмо: историю светлого завтра, бесконечную похвалу великому руководству Советского Союза (бывшего СССР) и «божественное» учение Михаила Горбачева.

Улицы Праги были довольно пустыми, как и большинство магазинов, отчаянно ожидавших очередных поставок апельсинов или бананов с Кубы.

В любом случае, делать было нечего. В городе не было ни торговых центров, ни фастфудов. Ресторанов было очень мало, и они были для привилегированных, в основном высокопоставленных коммунистических лидеров. Единственным вариантом было пойти в кино, но большинство кинотеатров показывали одни и те же два или три фильма по всей республике, которые в основном создавались «великими художниками» Советского Союза.

Мне было 15 лет.

Я вырос в этой «серости» коммунизма, и благодаря блестящей вездесущей пропаганде я понятия не имел, насколько скучной или угнетающей была жизнь при Коммунистической партии, поскольку у меня не было никакого сравнения. «Запад» для нас был врагом, и мы понятия не имели, что происходит по ту сторону железного занавеса. Итак, для меня это был просто «ещё один день», и я решил сделать то, что я всегда делал в те серые дни: остаться дома и изучать кодирование на языке программирования BASIC на своем компьютере Commodore 64.

Если вы удивились, что у нас был компьютер в эти тёмные дни угнетения, когда ничего «с Запада» не разрешалось, я не виню вас. Позвольте мне объяснить.

Как вы, вероятно (и правильно), подозреваете, иметь компьютер действительно было крайней редкостью (и даже немного «опасно»). Вы не могли купить их в государственных магазинах. Если вы хотели компьютер, вы должны были контактировать с людьми, которым было разрешено выезжать за границу, и упросить их контрабандой ввезти его в страну для вас – за очень большую взятку.

И, наконец, даже если вам посчастливилось выйти на кого-либо, кому разрешали выехать за границу и кто бы мог тайно провезти вам компьютер, вам всё равно было лучше держать это в секрете. Вы никогда не знали, когда тайная полиция может прийти к вам в квартиру и обработать вас на предмет того, как неуместно владеть вещами, которые пришли с «Запада».

К счастью, у меня были замечательные родители, которые знали, насколько сильно я был увлечен компьютерами. И мой отец имел «отличную репутацию, связанную с внесением большого вклада в развитие социализма» (поскольку он работал в крупнейшей государственной строительной компании и всегда был надёжным трудолюбивым отцом двоих детей). Имея такую благоприятную репутацию, ему, вероятно, могли сойти с рук небольшие «преступления», такие как владение компьютером, поэтому он был готов рискнуть. И по стечению обстоятельств у нас также был большой друг семьи, который имел привилегию выезжать за границу и время от времени заниматься «контрабандой».

По правде говоря, он уже приобрёл себе Commodore 64. И поскольку моему отцу очень нравилась идея иметь компьютер (потому что он любил Pac Man, Pit Stop и некоторые другие игры), он был готов дать взятку.

Так в начале 1989 года была успешно завершена операция по контрабанде компьютера Commodore, и наша семья стала успешным обладателем Commodore 64 с 5,25-дюймовым дискетным накопителем и двумя джойстиком! Вероятно, я был единственным подростком во всём квартале, у которого был компьютер, но мне разрешили делиться работой на нём только с несколькими «доверенными друзьями».

Во всяком случае...

Как я уже упоминал, я был одержим компьютерами. Настолько, что когда я впервые увидел эту невероятную «вещь», я не мог оторвать от неё рук в течение 10 долгих часов. Я был заморожен и загипнотизирован. Это была самая волшебная игрушка во вселенной, и я был глубоко очарован всеми глупыми вещами, которые она могла делать: подачей звукового сигнала, вводом слов на телевизоре, простыми играми, такими как Pac Man, и выполнением расчётов по высшей математике.

Всё это казалось мне высшим достижением человечества! В компьютерах я сразу увидел будущее. **Моё будущее.** Я видел гораздо более глубокие сумасшедшие вещи, которые можно было сделать с помощью компьютера, чем просто играть в игры. Я думал, что однажды он сможет стать удивительным инструментом для зарабатывания денег. **Кучи денег.** Я видел **революцию**. Тем не менее, я понятия не имел, что за углом происходит гораздо более масштабная революция в буквальном смысле!

В тот серый вечер 17 ноября 1989 года я сидел за своим Commodore 64, работая над новым кодом и пытаясь визуализировать математические уравнения более высокого уровня.

Но по какой-то причине я ощущал беспокойство. Я не мог сосредоточиться.

Моя концентрация была очень низкой.

Как будто какое-то странное, почти необъяснимое электричество проходило по всему моему телу.

В воздухе царил некто.

Я чувствовал, что в любую минуту может произойти нечто **грандиозное**. Нечто страшное. Но и в то же время нечто великое. Нечто, находящееся за пределами моей семьи и, возможно, чьего-либо понимания.

Было уже около 8 часов вечера, и мне пришлось на несколько минут отойти от экрана, чтобы подышать свежим воздухом и снять всё это необъяснимое напряжение. Я пошёл в другую комнату, где был небольшой балкон. Нам посчастливилось жить прямо в центре Праги, в красивом историческом здании с 4-метровыми потолками. Как правило, квартиры такого размера резервировались для привилегированных. Если только тебе не повезло, что тебя приписали к одному из них, как это было в случае с нашей семьей.

Я подошёл к задней части комнаты, раздвинул шторы (большинство людей зашторивали окна, чтобы тайная полиция не могла шпионить за ними) и открыл дверь на балкон. Я вышел и сделал глубокий вдох. А затем...

... Я застыл.

Глядя на улицу, я не мог поверить своим глазам. Улица была **заполнена** полицейскими.

Они были сильно вооружены, одеты в пуленепробиваемые жилеты, с большими шлемами на головах.

И с дубинками в руках.

Их было сотни, а, может, и тысяча. Они выглядели почти как спецназовцы. Учитывая, насколько узкой была улица, они заполнили её полностью. Вся эта сцена выглядела пугающе. **Было очень страшно.**

Я позвал маму и папу, чтобы они могли увидеть это невероятное зрелище. Они присоединились ко мне на балконе и сразу же очень испугались.

Это выглядело неестественно. Да, мы жили в репрессивном, жёстко контролируемом режиме, но, по иронии судьбы, так как он был настолько жёстко контролируемым, он был довольно безопасным. На улицах всегда была полиция, везде, но обычно там было только два или три полицейских, и они никогда не были **так** сильно вооружены.

Так что сцена перед нами была действительно пугающей. Очевидно, происходило нечто **грандиозное**, и мы понятия не имели, что это было. На самом деле, мы даже не были уверены, безопасно ли оставаться на балконе. Коммунизм был той эпохой, когда вы не хотели, чтобы вас видели среди властей, ни при каких обстоятельствах. Просто быть свидетелем чего-то подобного могло привести вас к потенциальным нежелательным неприятностям – вплоть до того, что вас даже могли посадить в тюрьму!

Но в тот вечер мы были настолько парализованы всей этой сценой, что даже не могли пошевелиться. Мы в буквальном смысле стояли как вкопанные на нашем маленьком балконе, и все мы, включая моего младшего брата, пытались понять, что происходит на Земле. И не могли понять... всё это так отличалось от любого предыдущего опыта, это было вопреки всем нашим коммунистическим условиям и далеко за пределами нашего понимания. Таким образом, мы просто стояли молча, глядя на всё происходящее.

А потом это **произошло**.

Вдруг в конце улицы начала появляться **огромная** толпа.

Вначале это было всего несколько десятков человек.

Потом сотни.

Потом тысячи.

А потом **десятки тысяч**.

И все они совершали самое опасное, что можно было сделать при коммунистическом режиме – они вышли на **демонстрацию**.

Демонстрация была строго запрещена. Демонстрации были настолько опасны для данного режима, что юридически их даже классифицировали худшим преступлением, чем убийство. В 1989 году никто не рискнул бы пойти на демонстрацию. **Никто.**

Но на сей раз они вышли.

Десятки тысяч наших соотечественников, демонстрантов. Мужчины, женщины, в основном молодые, но были и постарше.

Они лились как бесконечный огромный живой организм с улицы Народной триды на улицу Микуландскую, где мы смотрели на происходящее с нашего балкона.

Всего за несколько минут толпа демонстрантов заполнила всю улицу. И хотя мы не могли видеть, что происходило за углом, было очевидно, что там должно было быть больше (десятков) тысяч.

Затем вся толпа внезапно остановилась.

Прямо перед этим огромным батальоном полицейских.

Они стояли с готовностью противостоять им любыми средствами.

Демонстранты казались абсолютно бесстрашными. Абсолютно крепкими, неустрашимыми, стоящими прямо перед полицией с уверенностью, которая сама по себе могла рассматриваться данным режимом как преступление.

А потом без всякого страха, без заботы о последствиях – начали **протестовать**.

Пронзительно выкрикивать антикоммунистические лозунги.

Против правительства.

Против тоталитаризма.

Даже против наших советских вождей – то, что никто и никогда не осмеливался сделать, так как это было величайшим преступлением из всех.

Полиция казалась парализованной, в таком же шоке, как и все остальные, как и это немыслимое, невообразимое событие.

Это было самое страшное, с чем столкнулся этот режим, поскольку он привык контролировать всё и **каждого**. Казалось невозможным, чтобы могло произойти нечто подобное.

Тем не менее, это произошло. Это было реальностью.

Это было настолько реальным, что, наконец, всё стало понятным:

Мы стояли в самом сердце **революции**.

Это была огромная стихийная революция против репрессивного коммунистического режима.

Революция, вызванная толпой бесстрашных людей – толпа была настолько огромна и настолько решительна, что полиция понятия не имела, как действовать дальше. Ничего подобного не происходило десятилетиями. И несмотря на всю жестокость, которая последовала всего несколько минут спустя, свидетелем которой я также являлся, была развязана непреодолимая сила.

Революцию уже не остановить.

Было ясно, что толпа **не** остановится ни при каких обстоятельствах.

Никакое количество полицейских сил не заставит их отступить или изменить своего мнения. Тем не менее, полиция ответила силой, и последовала кровавая двухчасовая уличная битва.

Но решимость народа бороться за окончательную свободу была настолько очевидной и настолько сильной, что дух демонстрантов уже был победоносной силой. Той ночью Бархатная революция победила, хотя потребовалось ещё несколько недель, прежде чем победа завершилась падением старого режима.

Итак, после двух часов ожесточённой битвы полиция сдалась и оставила место происшествия ликующим демонстрантам. Прошло несколько дней, в течение которых состоялось ещё несколько демонстраций с участием **миллионов** людей, после чего, наконец, коммунистический режим капитулировал.

Через несколько недель наша революция начала распространяться на другие страны бывшего «Восточного блока»: Румынию, Болгарию, Восточную Германию, Польшу – на все эти страны.

Затем пала Берлинская стена.

И, наконец, через несколько месяцев распался СССР.

Это была самая важная революция в истории современной Европы, известная как **бархатная революция** – она изменила **всё**.

И в тот вечер 17 ноября 1989 года мир 15-летнего ребенка преобразился. События той ночи полностью изменили всю мою парадигму и сформировали моё философское мировоззрение на всю оставшуюся жизнь.

Потому что в тот день я узнал, что революции **реальны**.

Я узнал, что в **жизни возможно всё**, несмотря на **все** трудности и любые препятствия, которые вы можете себе представить.

Я обнаружил, что **серьёзные изменения** в вашей жизни могут произойти в **любое время**.

Я понял, что такое **свобода** и, что ещё более важно, что означает **борьба за свободу**.

В тот вечер многие из моих старых убеждений развалились, как и вся коммунистическая эпоха.

И внутри меня родился совершенно новый взгляд на мир:

Надежда.

Вера.

Возможности.

И прежде всего...

Свобода.

С того дня я **понял**, что вся моя жизнь полностью изменилась.

Что буквально **всё** было возможно, и эти невообразимые результаты были достижимы. **Я знал**, что я свободный человек и могу создать любую жизнь, какую только захочу, **несмотря ни на что**. **Я знал**, что революции происходят в реальной жизни и что я могу создать революцию в своей личной жизни в любое время, когда только захочу.

Тем не менее, мне потребовалось довольно много времени, чтобы достичь полноты этого видения!

17 ноября было днём полного освобождения.

И это было также начало моей невероятной жизни и построения карьеры в трейдинге – путешествия, которое в конечном итоге привело к ещё большей свободе: свободе, о возможности которой я не мог и думать никогда... до того дня.

Абсолютная свобода от работы с 9-ти до 5-ти.

Окончательная свобода от корпораций и от «системы».

Свобода от шума и суеты жизни, которые известны большинству.

Финансовая свобода.

Свобода распоряжаться своим временем.

Свобода работы.

Свободы, которые вы, читатель этой книги, теперь тоже имеете возможность испытать.

В этой книге я покажу вам, **как** именно это сделать.

Революция в трейдинге

Меня зовут Томас Неснидал, но в торговом сообществе я известен как «Мистер Пробои». И теперь вы знаете мою «историю происхождения»: рассказ о ребёнке, родившемся в тёмную эпоху глубоко репрессивного коммунизма... а затем вырвавшимся из неё, ставшем свидетелем невероятных изменений и сформировавшем веру в то, что буквально **всё** возможно.

Из-за революции я стал очень **верующим**, и хотя время от времени я забывал продолжать верить, ничто никогда не уводило меня от этой основной веры. И эта вера в возможное помогла мне пройти мой долгий путь, как вы узнаете дальше из этой книги.

Фактически она также помогла мне стать одним из ведущих мировых **специалистов по торговле на пробоях**. Большая часть моей жизни была посвящена свободе и торговле **на** пробоях.

Но это не произошло в одночасье. На самом деле, после революции и окончательного падения «железного занавеса» у меня впереди был ещё целый путь.

Послереволюционные годы были в буквальном смысле сумасшедшими. Внезапно мы смогли путешествовать, выбирать работу, которую мы хотели, читать книги, которые ранее были запрещены, открывать собственный бизнес и делать тысячи других вещей, которые ранее не разрешались.

Этот скачок от глубокого угнетения к полной свободе был настолько резким и неожиданным, что многие люди столкнулись с реальными проблемами. Масса изменений происходила столь стремительно, и каждый день открывалось столько новых возможностей, что многие люди были буквально парализованы, будучи не в состоянии решить, что делать и с чего начинать.

Со своей стороны, я всегда был очень решительным человеком и точно знал, чего хочу. Итак, я начал со свободного выбора моего образования. Почему-то меня всегда тянуло в киноиндустрию, поэтому я решил поступить в киношколу.

Моя студенческая жизнь была действительно удивительной, глубоко богемной, и я очень любил её. Мне было очень весело, я снял кучу короткометражных фильмов и встречался со многими красивыми чешскими девушками, которых встречал на своём пути! Кроме того, мои фильмы были настолько успешными, что вскоре я начал посещать многочисленные международные фестивали. Я посещал один юношеский кинофестиваль за другим, ездил из одной страны в другую... И самое приятное было то, что мне даже не нужно было платить за это, так как большинство фестивалей покрывали все мои расходы!

Более того, то, что не покрывалось фестивалем, оплачивалось моей школой, поскольку мои фильмы стали самой успешной студенческой работой в истории киношколы.

Ещё одним преимуществом освобождения от коммунизма был расцвет творчества, и мне повезло, что я был частью этого.

Итак, я много путешествовал, пользовался большим успехом и вниманием (но также и большой завистью), меня даже приглашали в такие «экзотические» страны, как Япония. Фактически я был одним из первых чешских граждан, кто посетил Японию после революции. И в результате о моей поездке в Японию был снят короткометражный документальный фильм, который транслировался на первой частной чешской телевизионной станции!

Весь этот этап моей жизни, жизни в полном согласии с новым осознанием того, что **всё** возможно, был одной весёлой поездкой, которую я никогда не хотел заканчивать. Но, как и все хорошие вещи, она, конечно же, закончилась.

В то время у меня был одноклассник, который стал моим очень хорошим другом. Он был первым биржевым трейдером, которого я встретил до того времени.

Его звали Дэниел, и он зарабатывал деньги как трейдер, параллельно изучая искусство фотографии. После первого года обучения в киношколе ему удалось собрать небольшое состояние (по студенческим меркам) со своей работы в области фотографии, и поскольку он был довольно предприимчивым, он решил инвестировать в местные акции. Это было в те времена, когда Чешская Республика создала и запустила свою первую фондовую биржу, и, как и в случае со многими «развивающимися рынками», в то время было довольно легко заработать много денег. На рынке было много оптимизма и энтузиазма, и в течение многих лет восходящий тренд был единственным рыночным трендом. Дэниел быстро стал самым богатым парнем в классе, и ему даже не пришлось много работать для этого!

Но в то время я ещё не обращал внимания на рынки. Я был слишком занят своими фильмами и путешествиями.

И поскольку я так много путешествовал, я вскоре стал зависимым от этого. Вспоминая об этом сегодня, я могу ясно видеть, как все эти студенческие поездки на кинофестивали по всему миру сформировали мою самую большую страсть в жизни помимо трейдинга — страсть к **путешествиям**! Я знал, что **это** (путешествие) было тем, чем я хотел заниматься всю оставшуюся жизнь, и я был полон решимости продолжать идти вперёд, чтобы полностью реализовать эту недавно открытую страсть.

Итак, помимо создания больших фильмов, у меня было ещё одно очень захватывающее видение моей жизни после окончания учебы.

Наконец, после четырех весёлых лет, перегруженных надеждой и оптимизмом, я закончил учёбу.

Но потом, как это обычно бывает, началась реальная жизнь, и у меня проявилась тёмная тень дефицита средств. Впервые в жизни мне не хватило денег, чтобы удовлетворить свои потребности. Мои мечты начали рушиться быстрее, чем я мог найти какие-либо решения.

Правда в том, что вхождение в киноиндустрию было, вероятно, самым рискованным шагом в моей карьере. После падения коммунизма пала и вся государственная система субсидирования деятелей искусства и культуры. Было почти невозможно получить финансирования для фильмов, если вы не были уже очень успешным режиссёром с «проверенным именем», которого у меня, к сожалению, не было!

Мои успехи как студента, возможно, никогда бы не свершились. Никто не интересовался моей прошлой работой и не обращал на неё ни малейшего внимания.

Не было никакого интереса ни ко мне, ни к моим «великим идеям». Вся посткоммунистическая киноиндустрия была крайне сложной, и мои мечты о создании отличных фильмов и путешествиях по миру начали угасать.

Кроме того, вся нация, казалось, **была одержима** деньгами и имуществом – тем, что ранее было неизвестно при коммунизме. Внезапно мы могли владеть собственностью, ходить по магазинам, становиться потребителями. Практически для всех это было настолько новым, что деньги и имущество стали первой целью, а искусство рассматривалось как устаревший пережиток прошлого. Поскольку я никогда не питал интереса к имуществу (и не питаю его до сих пор), я чувствовал себя совершенно потерянным. Я думал, что был на грани того, чтобы стать голодающим художником лишь для того, чтобы умереть в очень молодом возрасте, как главный герой моей любимой оперы «Богема».

Я должен был что-то предпринять. Я не мог просто сидеть и мечтать. Я был молод, у меня было много энергии, и я хотел изучить другие доступные мне варианты. Поэтому вместо того, чтобы снимать фильмы и путешествовать по миру, я решил столкнуться со своим самым большим страхом и сделать то, что, как я уже знал, я бы полностью ненавидел. Я решил **устроиться на работу**.

На настоящую скучную работу с 9-ти до 5-ти.

Ну, если честно, она была не такой уж и скучной, как могла бы быть. На самом деле моей первой работой была отличная должность в американской сети платного телевидения HBO. Мне предложили роль сценариста-продюсера, крайне привлекательную работу для того, кто только что закончил киношколу. И у меня была хорошая зарплата – почти в три раза больше средней зарплаты на тот момент.

Так что всё было не так уж и плохо. Я всё ещё работал в индустрии развлечений, у меня была команда сценаристов, продюсеров и редакторов, и я зарабатывал кучу денег.

Но... Это была **работа**.

И как вольный человек, которым я стал в те дни революции (ещё одно влияние этого невероятного события), я вскоре понял, что просто не могу вынести образа жизни наёмного сотрудника.

Это не то, как я представлял себе свою **свободу**.

Я хотел **путешествовать**.

Я хотел **жить** и **исследовать** жизнь.

Итак, после трёх месяцев, несмотря на то, как хорошо все в компании относились ко мне, и на невероятную зарплату, которую я получал, я уволился.

Сразу же после этого я попытался вернуться в киноиндустрию. Мне удалось сделать несколько короткометражных документальных фильмов для национальной телевизионной станции, но это была низкооплачиваемая работа, и её хватило только на то, чтобы покрыть мои основные расходы на жизнь.

От отчаяния я попробовал другую работу на полный рабочий день. Но на этот раз опыт работы с 9-ти до 5-ти был ещё хуже. Через три месяца я снова ушёл, и я поклялся себе, что больше никогда не буду наёмным работником! Я пообещал себе, что это будет последняя наёмная **работа** в моей жизни. Я был готов умереть (да здравствует Бог!), а не играть роль наёмного работника, глубоко укоренившегося в каком-то лабиринте корпоративного мира, который меня не интересовал.

К счастью, были и другие варианты для изучения. Я по-прежнему обладал талантом, и у меня было много творческих идей и много энергии. Поэтому я решил стать предпринимателем.

Вместе с другом я основал компанию по производству телевизионной рекламы. Мы хотели быть самой креативной рекламной командой в Праге. Мы собрали тонну интересных идей и начали предлагать их различным брендам, компаниям и рекламным агентствам. И после трудного первого года мы, наконец, начали набирать обороты, получили несколько хороших клиентов, и я даже снял одну высокобюджетную (по чешским меркам) телевизионную рекламу и серию рекламных роликов для бренда Sprite от компании Coca-Cola.

Однако вся эта отрасль была невероятно сложной. Огромная конкуренция. Процветающее взяточничество (пережиток коммунистической эпохи). Невероятный стресс и давление. Должен признать, что несмотря на все наши прекрасные работы, которые мы выполняли благодаря нашим творческим идеям, я ненавидел эти годы. Это было полной противоположностью тому, что я себе представлял. Я чувствовал себя в ловушке.

Я оказался в «крысиной гонке», как описывает это Роберт Кийосаки в своем блоге «Богатый папа».

После трёх или четырёх изнурительных лет я осознал, что мне нужно заняться чем-то **другим**. Чем-то лучшим. Чем-то, что соответствовало моему видению и цели **свободной жизни**, которую, как я **знал**, я могу получить. Я **знал** это каждой клеткой в моём теле, потому что у меня уже был этот удивительный опыт бархатной революции.

Я **знал**, каково это – выйти из глубокой тьмы (которая теперь была для меня работой с 9-ти до 5-ти) в абсолютную свободу. Я знал, каково это и что я чувствовал, и я просто **знал, что** это можно сделать, даже на очень личном уровне. Я знал, без сомнения, что после революции **нет ничего** невозможного, несмотря ни на что.

Тем не менее, через несколько лет я также бросил предпринимательскую игру. Будучи «разрушенным жизнью» (даже еще не имея 30!), я решил взять отпуск на несколько месяцев и ничего не делать. Я переехал к другу за пределы Праги, где мы просто смотрели фильмы и весь день ели нездоровую пищу!

И я вообще не мог жаловаться на эту простую жизнь. В глазах большинства моих друзей, у которых уже была «реальная работа», я выглядел полным чудаком. Но я жил так, как хотел, веселился, не беспокоясь об ипотеке, сбережениях на будущее или о любых других вещах, которыми были одержимы все окружающие меня.

Я жил своей богемной жизнью, и мне она нравилась! Я действительно гордился собой за то, что бросил вызов всем ожиданиям.

Однако, к сожалению, снова начала проявляться «денежная реальность».

После двух месяцев идиллического расслабления мой небольшой банковский баланс быстро испарился. Снова начали всплывать мысли о «Богеме»... Я снова почувствовал, что моя жизнь закончилась. Только в этот раз я уже думал, что, вероятно, умру голодающим художником в свои 30 лет, а не в 20. Это был такой прогресс!

Но иногда жизнь может удивить вас, и когда вы думаете, что достигли дна, появляется новая возможность из ниоткуда. Именно так и произошло.

Это было лишь небольшим открытием, но в то время решающим: благодаря удивительному стечению благоприятных обстоятельств одному другу удалось устроить меня на небольшую работу.

Это были короткие мюзиклы с рекламным агентством, на которое он работал. Им нужен был опытный писатель для сценария телевизионной рекламы, и поскольку у меня были полномочия, опыт и хорошая репутация, я не только получил работу, но даже сумел взять огромную премию за свои услуги.

Эта небольшая работа (для написания сценария мне требовалось всего 2 часа, и мне платили за него больше, чем средняя зарплата за два месяца в то время) вытащила меня из надвигающейся финансовой нищеты, и на некоторое время я снова был спасён.

Но на этот раз я решил, что **не** буду просто тратить деньги.

На самом деле, я начал чувствовать себя немного выгоревшим от моего богемного образа жизни. Волнение от того, что вы ничего не делаете, кроме просмотра фильмов и еды в течение всего дня, вскоре превратилось в скуку. Это не сильно отличалось от работы с 9-ти до 5-ти... Мне нужно было больше самореализации.

Теперь я полностью оправился от всех предыдущих рабочих стрессов и «травм». Энергия в полном объёме вернулась ко мне, и я чувствовал, что пришло время начать исследовать новые возможности.

На этот раз, однако, я хотел быть немного более **подкованным**.

Я не хотел повторять тех же ошибок. Я не хотел делать ничего, что могло бы сжечь меня, ограничить меня или отложить мечты моей жизни.

После некоторого размышления у меня возникла наивная идея, что я мог бы каким-то образом **инвестировать** деньги, которые я только что заработал, вместо того чтобы тратить их ни на что. Тогда я мог бы жить за счёт этих крошечных, небольших инвестиций, путешествовать и делать всё, что захочу.

Великолепный план!

Воодушевлённый этим новым видением, я сделал первое, что пришло мне в голову: я позвонил своему приятелю со студенческих лет – **Дэниелу**!

Как я благодарен тому, что у меня был такой друг – опытный инвестор, который наверняка скажет мне, как инвестировать мои несколько пенни, а затем переехать жить в Карибский бассейн! По крайней мере, это то, что пришло мне на ум.

К сожалению, мой разговор с Дэниелом был похож на очень холодный душ.

Дэниел был далёк от той жизни, которой, как я себе представлял, он мог бы достичь к тому времени. Во-первых, вместо того чтобы сидеть на пляже, у него была **полная занятость**. Какая катастрофа, подумал я.

Это всё случилось с ним через год или два после окончания школы, когда он поставил все деньги, которые заработал на торговле акциями, на **одну** конкретную компанию (это была **огромная** ошибка!) и понёс колоссальный убыток. Ему пришлось начинать всё сначала: устроиться на работу, сэкономить немного денег, учиться на своих инвестиционных ошибках и строить свой бизнес по торговле на фондовом рынке с нуля.

Хуже того, он потерял уверенность в том, что **всё** возможно. И это было довольно грустно, так как он пережил бархатную революцию практически так же, как и я.

Я был глубоко разочарован. Это **не** было хорошим знаком. Но, по крайней мере, я получил от него отличные советы и рекомендации, а также полезные ссылки в Интернете, которые он мне порекомендовал. Я изучил информацию, но она мне не очень помогла. На самом деле, моё разочарование усилилось, когда стало очевидным, что мои микроинвестиции никогда не принесут мне больше, чем просто копейки, даже если я буду инвестировать очень хорошо.

Я снова начал чувствовать себя побеждённым.

Я чуть не решил сдаться... Это было похоже на пробуждение от великого сна, возвращение к «кошмару реальности». В очередной раз я был убеждён, что умру голодающим художником в свои тридцать лет, забытый всеми.

Но потом случилось нечто невероятное.

Почти случайно, когда меня наконец убедили сдаться и закрыли последний из Интернет-ресурсов Дэниела, я наткнулся на статью о **внутридневном трейдинге**.

Это было нечто совершенно новое для меня. До этого момента я никогда не слышал о внутридневном трейдинге.

Я переварил статью буквально за несколько минут.

Я полностью попался на крючок. И хотел получить еще **больше** информации.

Я снова запустил Yahoo (Google в те времена еще был в зачаточном состоянии) и искал всё о внутридневном трейдинге. В течение следующих нескольких дней я только и делал, что читал все эти статьи, делая кучу заметок и пытаясь понять этот захватывающий новый мир. Я почти не мог ни есть, ни спать.

После нескольких недель обучения я решил купить свою первую книгу по трейдингу. Она прибыла из США через месяц (это было задолго до появления Amazon, и такие задержки поставок считались нормальными). Я прочитал её за один день и сразу же заказал ещё дюжину.

Я начал всё глубже и глубже погружаться в мир трейдинга, фьючерсных рынков, технического анализа, торговых паттернов и сетаров, а также секретов внутридневной торговли.

И через несколько месяцев, когда у меня было достаточно информации, знаний и понимания, чтобы синтезировать всё это в большую, более полную картину и практический, осуществимый план, я **знал**, что **это** было именно то, что я искал.

Я знал, что трейдинг был моим ответом на **всё**. На нём мои поиски закончились.

Я нашёл свой путь к свободе, к той жизни, которую я хотел. Остальное стало достоянием истории.

Я был так взволнован этим фантастическим открытием, что решил устроиться на краткосрочную работу помощником директора по американскому производству в Праге, договорившись о зарплате, которая позволила бы мне финансировать мой первый торговый счёт.

Я был готов идти вперёд, поэтому начал совершать свои первые сделки на реальном рынке.

Я начинал как дискреционный дневной трейдер. Мне потребовалось несколько лет, чтобы разобраться во всём этом (намного дольше, чем я ожидал), и в течение этих лет мне приходилось брать больше специальных работ, чтобы поддерживать себя и финансировать свой торговый счёт. Но на этот раз я не возражал, потому что у меня стояла определённая цель и чёткое видение, которое я был полон решимости исполнить любыми необходимыми средствами.

Наконец, через несколько лет я смог полностью обеспечивать себя исключительно доходами от трейдинга.

Чувствуя себя в финансовой безопасности, я сделал предложение своей девушке, женился и переехал со своей невестой в Португалию, чтобы жить у моря – мечта, которую мы оба разделяли. Мы создали там новую жизнь. Тихая, приятная, спокойная, здоровая жизнь.

Больше никакой суеты. И, кроме того, мы **много** путешествовали вместе. У нас с ней всё сложилось, всё прекрасно развивалось, и я был самым счастливым человеком на свете.

Это была моя **вторая революция**.

Я думал, что она была последней.

Тем не менее, впереди предстоит ещё более масштабная революция.

Самая большая.

Революция пробоев

Я стал внутридневным трейдером, и мне это **очень понравилось**.

Это был **идеальный** способ заработать на жизнь. Именно то, о чем я всегда мечтал. Всё, что мне было нужно, чтобы содержать себя и свою жену в финансовом отношении – это мой ноутбук и хорошее подключение к Интернету.

Для меня это была окончательная свобода.

Конечно, это не всегда было легко. У меня были как отличные торговые месяцы, так и действительно плохие месяцы. И мне ещё многому предстоит научиться. По мере развития моей карьеры внутридневной торговли, чтобы справляться с давлением со стороны просадок и не очень хороших дней, я начал регулярно медитировать. Медитация быстро стала ещё одной моей страстью, наряду с моей преданностью трейдингу.

Я любил учиться и совершенствоваться и продолжал изучать новые торговые направления. Как я уже говорил, всё шло хорошо. До тех пор, пока... Мартина и я не совершили трёхмесячную поездку в Восточную Азию.

Это была долгожданная и давно запланированная поездка. Мы всегда мечтали провести некоторое время в Восточной Азии, и эта предстоящая поездка была ещё одной мечтой.

Однако я не осознавал, что из-за неблагоприятного сдвига во времени было невозможно продолжать внутридневную торговлю во время путешествий в этой части мира. Например, Малайзия опережает Чикаго на +13 часов – это означает, что открытие рынка в 09:30 в Чикаго

происходило в 22:30 в Куала-Лумпуре. И, поверьте мне, это **очень тяжёлое** время для дискреционной внутридневной торговли! Особенно после проведенного целого дня в жаркую влажную тропическую погоду.

Итак, хотя поездка была **потрясающей** и мы полностью влюбились в Восточную Азию, она также была довольно дорогой, особенно учитывая, что за всю поездку я не зарабатывал никаких денег, так как не мог торговать из-за разницы во времени. Это было разочаровывающе.

Мы решили, что вернёмся в Восточную Азию в следующем году на ещё более длительный срок, возможно, до шести месяцев. Но для этого нам потребовалось бы **много** денег, ведь я просто не мог позволить себе такую поездку без дохода. (Хотя я не отношусь к категории тех парней, которые одержимы материальными вещами, должен признать, что я определённо предпочитаю 5-звёздочные отели и курорты! Даже тогда, во время путешествия, мы обычно выбирали лучшее жильё.)

Мне нужен был новый **план**.

План, который позволил бы мне поднять свою торговлю на следующий уровень, где я не только наслаждался бы свободой торговли, но и мог бы свободно торговать в **любом часовом поясе**.

Нужна была ещё одна **революция**.

Это стремление к следующему уровню привело меня к более глубокому изучению торговли **опционами**.

К тому времени я встретил несколько отличных трейдеров, торговавших на опционах, и от них получил хорошую основу. Я знал, что они проводят гораздо меньше времени перед своими компьютерами, чем я, и также знал, что как опционный трейдер я определённо могу торговать независимо от того, в каком часовом поясе нахожусь.

Я решил углубиться в торговлю опционами и выяснить эту новую и совершенно другую торговую игру.

Правда в том, что опционы являются крайне сложными. Торговля этими инструментами требует больших умственных способностей, и я отдаю должное своей способности мыслить творчески (и, следовательно, абстрактно) за лёгкость, с которой я смог разобраться во всех цепочках, дельтах, вегах, тетах и других таинственных терминах, связанных с опционами.

Наконец, через некоторое время и с огромной помощью моего друга и наставника по опционам Майка (которому я посвящаю эту книгу) помимо моей внутридневной торговли на фьючерсах я начал торговать опционами и стал зарабатывать на этом деньги.

Однако, как бы весела ни была торговля опционами, должен признать, что я не был в восторге от результата этого эксперимента.

Во-первых, торговля опционами была скучной и медленной по сравнению с внутридневной торговлей. Во-вторых, я даже и близко не зарабатывал столько, сколько получал от своей внутридневной торговли. Так что через некоторое время я понял, что это не то, что мне было нужно... Мне всё ещё нужна была другая, **другая** революция в трейдинге.

К счастью, мне не пришлось долго ждать. Как это часто бывает в моей жизни, Вселенная была довольно снисходительна ко мне.

В то время мы с женой всё ещё жили в Португалии, но я часто путешествовал в свою родную Чешскую Республику. Поскольку моя история успеха в трейдинге стала довольно популярной, я часто фигурировал там на крупных телеканалах и в журналах. В результате я имел честь

провести там несколько крупных торговых семинаров и даже был соавтором трёх самых продаваемых книг по трейдингу на чешском языке.

Благодаря этому я смог встретиться со многими другими трейдерами и наладить хорошие дружеские отношения с некоторыми из них. (Несколько лет спустя самые лучшие и самые талантливые из них стали ключевой командой моего хедж-фонда).

И поскольку эти трейдеры всегда были моей командой и моими лучшими «приятелями», со временем я пригласил нескольких из них в Португалию.

Мы вместе весело провели время, наслаждаясь жизнью, а также обменялись торговым опытом и идеями. Таким образом, мы все продолжали расти и поддерживать друг друга. И когда я пригласил своего друга Милана в Португалию, я получил большой прорыв, на который надеялся.

Он был моим бывшим студентом из Праги, который преобразовал свою внутридневную торговлю в полностью автоматизированную систему. Он был весьма успешен в этом. Это звучало как отличное решение для моих планов путешествовать и жить в Восточной Азии со всеми проблемами часового пояса. Но в то же время я был очень подозрителен. Не по поводу Милана, а по поводу идеи алгоритмического трейдинга.

Будучи дискреционным трейдером, я развил в себе хорошее «чувство» в отношении рынков и ряд важных когнитивных навыков. Я не верил, что это может быть воспроизведено компьютером. Но я не хотел делать преждевременных выводов.

И должен сказать, что время, которое мы провели с Миланом в Алгарве, Португалия, было просто **потрясающим**. Мы совершили однодневную поездку на квадроциклах, устраивали легендарные барбекю и бродили по лучшим песчаным пляжам.

Но в основном мы говорили о трейдинге. И семя идеи, которое Милан посеял в моей голове, начало расти.

Милан был крайне щедр со мной, показывая мне **всё**, чего он достиг в своей алгоритмической торговле, включая не только свои невероятные живые результаты, но также и свои коды, и все свои торговые стратегии!

Я был ошеломлён.

Каким-то образом, несмотря на весь мой скептицизм, меня полностью привлёк мир автоматизированного, алгоритмического трейдинга Милана.

Это вызвало воспоминания о том, когда я впервые выучил язык программирования BASIC на моем Commodore 64. Это напомнило мне времена, когда я впервые понял, как компьютер может однажды принести большую **революцию** в мою жизнь и стать инструментом для создания потрясающей жизни.

Только вот Милан уже сделал это! Я чувствовал, что несколько лет провёл в спячке, потерянный в дымке изнурительной дискреционной внутридневной торговли.

И, что ещё лучше, стратегии Милана были **простыми**.

Большинство из них были основаны на идеях Ларри Уильямса, и поскольку я был большим поклонником Ларри и уже реализовал некоторые из его идей в своём подходе к торговле, всё это глубоко резонировало со мной. Единственная хитрость заключалась в том, что Милан добавил некоторые «навороты» или «новшества» в материал Ларри, чтобы он действительно работал. Это потребовало немного творчества, которое, опять же, не только резонировало с моим подходом, но и заинтриговало меня ещё больше.

После нескольких дней с Миланом я был на 100% убеждён в автоматизированном трейдинге. Опять же, я **знал**, что **это** было то, что мне нужно. Я знал, что нашел своё следующее направление и свою третью, окончательную **революцию**.

Как только Милан ушёл, я приступил к работе.

Я создал учётную запись на TradeStation – отраслевой стандарт в то время – и с радостью обнаружил, что их язык программирования EasyLanguage очень похож на BASIC, который я знал со своих подростковых времён, когда работал на компьютере Commodore 64. (Забавно, как Вселенная соединяет нити в гобелен нашей жизни!)

Первый месяц я потратил на то, чтобы научиться программировать простые идеи. У меня была хорошая кривая роста производительности, но это было не так сложно, как я думал.

Затем я начал изобретать и кодировать свои первые алгоритмические стратегии.

Я строил их на фундаментальных данных, которые узнавал от Милана, но я хотел дать его идеям мои собственные наработки – так же, как он это делал с концепциями Ларри, поэтому я часто отклонялся от них. Я хотел найти свой собственный путь, разработать свой собственный стиль.

Кроме того, я чувствовал нетерпение, так как уже видел себя в Восточной Азии, бродящим в течение нескольких месяцев подряд как полный хиппи (но останавливаясь в 5-звёздочных отелях) и позволяя моему компьютеру проделывать за меня всю работу!

Из-за этого острого нетерпения я кинулся исполнять свой первый торговый план, недооценив почти каждый из аспектов своего торгового процесса и совершая ошибку за ошибкой. Конечно, я читал, что есть подводные камни, о которых нужно помнить, но, тем не менее, я запустил свои первые алгоритмические торговые стратегии раньше времени и сразу же начал терять деньги.

Я потерял очень много денег и очень быстро.

Это снова меня приземлило. На поверхность всплыли сомнения и разочарование. Несмотря на всё время, которое я вложил в свою революцию алгоритмического трейдинга, я не смог заставить его работать.

Давление и разочарование нарастали. Уверенность в себе и самооценка понижались. И через несколько месяцев мне пришлось остановиться.

Я был совершенно потерян и пребывал в отчаянии, у меня не было ясного видения. Я был перегружен работой, у меня было слишком много бессонных ночей, и я больше не знал, что делаю.

Поэтому я решил заняться чем-то другим, чтобы на время забыть о трейдинге.

Я нанял тренера из Ассоциации профессиональных игроков в гольф (PGA) и начал практиковать игру в гольф. Я занялся плаванием. Начал бегать. Я снова посвятил себя внутренней практике и медитировал больше, чем когда-либо. Я даже научился готовить и серьёзно заинтересовался здоровым образом жизни.

И однажды, несколько месяцев спустя, когда я, наконец, избавился от всех разочарований в автоматизированном трейдинге, ко мне пришло **прозрение**.

Прозрение, которое позволило мне увидеть, что я делал неправильно всё это время:

Я одновременно делал всё и ничего.

Я прыгал от идеи к идее, но только поверхностно, без более глубокого понимания того, что я делаю.

Я пытался «воссоздать» и «заново изобрести» идеи Милана и Ларри, не тратя время, которое они оба потратили на глубокое понимание концепций.

Я был настолько одержим быстрыми лёгкими деньгами, что превратился в мелкого трейдера. Я забыл о своих творческих способностях, о своей уникальности и гонялся за всем, за что только мог уцепиться, не будучи твёрдо уверенным ни в чём.

Это был **не** я.

Я всегда любил глубину. Я всегда любил «общую картину» и любил мыслить концептуально.

Я всегда находил свой **собственный** путь, без необходимости подражать кому-либо... Я ненавидел быть бессмысленным подражателем.

Я чувствовал себя таким разочарованным, как будто предал себя. Я чувствовал себя виноватым, но в то же время и униженным.

И я знал, что должен вернуться к планшету и начать перестраивать свою торговую революцию с нуля.

Но я также не хотел выбрасывать всю эту предыдущую тяжёлую работу в мусорное ведро. Я вернулся ко всем своим неудачным стратегиям и изучил их, пытаясь найти что-либо, что может **резонировать** со мной.

Я сделал шаг назад, просмотрел все свои коды и искал более общую картину.

Я начал задаваться вопросом, есть ли какой-то потенциальный мост между моим предыдущим опытом дискреционной внутридневной торговли, в основе которой лежала **импульсная** торговля, и моим будущим личным уникальным стилем торговли.

Я провёл несколько дней, размышляя, концептуализируя и медитируя, чтобы глубже войти в контакт со своей уникальной подлинной сущностью.

И потом **меня осенило**.

По какой-то причине среди всех удивительных идей, которые я узнал от Милана, была одна, которую я использовал больше всего. Был один подход, в отношении которого я мог создавать буквально бесконечное количество вариаций, не моргнув и глазом.

Эта идея больше всего не давала мне покоя и высвободила во мне нечто очень мощное, давая мне возможность стать в ней крайне креативным.

И всё дело было в...

торговле на пробоях.

Всё начало складываться воедино, как идеальный пазл: конечно! Что же может быть ещё, если не **торговля на пробоях**?!

Она была так **близка** к дискреционному импульсному трейдингу, которым я уже занимался. Это было самое естественное его продолжение, и к ней мне почти не нужно было строить мост. Это была практически идеальная посадка.

Всё, что мне нужно было сделать, это углубиться в мои **уже реализованные** знания и опыт и начать расширять их.

Итак, я вернулся к TradeStation и удалил 99% стратегий, которые я разработал, сохранив только несколько идей торговли на пробоях, с которыми я начал играть.

Несколько недель спустя у меня было более 10 различных стратегий торговли на пробоях на разных рынках, в основном на индексах на фьючерсы. Но на этот раз я не торопился. Сначала я протестировал их на демо-счёте и пообещал себе не запускать их на реальном рынке, пока они не зарекомендуют себя как прибыльные стратегии по меньшей мере после 20 сделок (минимальный разумный размер статистической выборки).

И, к моему удивлению, некоторые из них действительно начали зарабатывать деньги. **Реальные** деньги.

Итак, это было окончательное подтверждение: алгоритмический трейдинг на пробоях был именно тем, что я искал.

В тот момент я решил стать первоклассным **специалистом по торговле на пробоях**.

Когда я углубился в это увлекательное и крайне плодотворное направление в трейдинге, я пообещал себе потратить на него как минимум 10 000 часов – это считается необходимым временем, чтобы стать настоящим недвусмысленным экспертом в какой-либо сфере. Я пообещал уделить ему 110% своего внимания, и мастерство торговли стало моим наивысшим приоритетом и целью №1.

В течение следующих нескольких месяцев мне удалось создать десятки алгоритмических пробойных стратегий. Некоторые из них по-прежнему были убыточными, но я продолжал становиться всё лучшим и лучшим в этом направлении.

С каждой новой неудачей я учился новым уловкам. Всё начало меняться по-крупному – отныне деньги стабильно поступали на мой торговый счёт.

Постоянно внося корректировки (оптимизацию), я наконец-то наткнулся на свою идеальную формулу торговли на пробоях. Именно этот прорыв в конечном итоге позволил мне выйти на десятки рынков, стать невероятно успешным, создать и запустить свой собственный хедж-фонд по торговле на пробоях, путешествовать по 65 странам, жить в разных местах, отправляться в роскошные круизы и многое другое.

Это был последний недостающий элемент моего путешествия в трейдинге.

Революция формулы торговли на пробоях.

Революция формулы торговли на пробоях

Моя окончательная формула торговли на пробоях, которую я полностью объясню в следующих главах, далась мне нелегко.

На самом деле это был довольно сложный процесс.

После того, как я, наконец, стал прибыльным благодаря полностью **автоматизированной** торговле на пробоях и полностью прекратил использовать свой дискреционный торговый план, оставались сомнения в том, будет ли это продолжать работать в долгосрочной перспективе.

Да, я уже знал, что автоматизированная торговля на пробоях была для меня конечным направлением. Я решил стать настоящим специалистом в этой области и, как правило, тратил

до 14 часов в день на изучение всего, что мог, об этом подходе. Я также провёл тысячи собственных тестирований и экспериментов на платформе TradeStation.

Но я всё еще чувствовал, что слишком много «прыгаю вокруг да около». Мне нужна была отточенная формула.

У меня всё еще не было «более высокой концепции» – того, что позволило бы мне структурировать мой уникальный торговый подход в доступный для дублирования метод. Когда кто-то спрашивал меня, что я делаю со своей торговлей, я не мог объяснить всего этого в нескольких предложениях. Это говорило о том, что мне нужна была бóльшая концептуальная **ясность**.

Итак, я начал думать, есть ли некий способ обобщения всего подхода несколькими простыми правилами.

Первая попытка не увенчалась успехом: когда я пытался структурировать всё это в OneNote, весь процесс был смехотворно сложным – слишком сложным и практически неисполнимым.

Это совершенно **не** подходило мне, поскольку я являюсь тем парнем, который любит ясность, прямооту и простоту.

Я предпринял ещё несколько попыток, но ситуация только ухудшалась.

Вскоре я почувствовал, что оказывал на себя слишком сильное давление, поэтому решил отложить всю эту идею на второй план и вместо этого сосредоточиться на разработке бóльшего количества стратегий торговли на пробоях.

Но желание систематизировать мой подход не исчезло. И, кроме того, меня попросили провести семинар по алгоритмической торговле на пробоях в Праге... Моя первая попытка обучить людей тому, что я до сих пор ещё не выяснил для самого себя!

С приближением семинара в Праге мне пришлось действительно подтолкнуть себя и выяснить, как объяснить всё то, что я делаю. Я был полон решимости представить свои идеи и захватывающую методологию таким образом, чтобы все мои удивительные последователи и ученики (которых я бесконечно ценю!) могли сразу же начать использовать их.

Я подготовил свою презентацию в PowerPoint, но не был доволен ею. Всё по-прежнему выглядело слишком сложно, слишком запутанно и слишком неконкретно. Не хватало одной простой обобщающей концепции.

Я был сильно расстроен!

Она казалась простой вещью, и я знал, что смогу изложить всю свою стратегию развития и торговый подход всего в нескольких предложениях. Я потратил на это всё свое время в течение нескольких месяцев. Это было тем, **ради** чего я **жил**! Так почему же мне было так трудно придумать этому простое объяснение?

Почему это всё казалось таким бессвязным, таким разрозненным?

Я был настолько поглощён всеми «движущимися частями» торговли на пробоях, что просто не мог видеть всей картины в целом.

Опять же, как я часто делаю в этих ситуациях, я решил на несколько дней отпустить этот вопрос. Я оставил свой компьютер и вместо этого провёл некоторое время, прогуливаясь по прекрасным пляжам Алгарве.

И вот, наконец, однажды поздно вечером я получил ответ.

Это произошло во время красивого заката с парящими в бирюзовом небе чайками, наслаждавшимися своей свободой.

Этот прекрасный закат был настолько потрясающим, что я полностью погрузился в него.

В какой-то момент я почувствовал себя неотъемлемой частью всей этой сцены. Это был глубокий духовный опыт, наполненный экстазом единства.

И в тот момент, когда я стал частью всей этой красивой картины, я понял, как оформить свою формулу торговли на пробоях. Моя проблема заключалась в том, что...

Я мыслил с точки зрения правил и слов!

Но...

Что, если вместо этого я представил бы её как простое изображение?

Так же, как мой мысленный образ этого заката, такой глубоко красивый и наполняющий, но в то же время великолепно простой и «очевидный» – то, с чем каждый мог легко установить контакт.

Достаточно было всего лишь взглянуть на него, чтобы «получить его», стать его частью и испытать его в полной мере.

Моя «формула» должна была быть картинкой, а не письменными правилами!

Воодушевленный этим блестящим пониманием, в машине по пути домой я сразу же начал рисовать некоторые первоначальные идеи в своей голове.

Добравшись до места назначения, я пошёл в свой офис, всё еще думая и излагая свои идеи примерно до полуночи.

А потом я так же легко пришёл к ней.

Я, наконец, понял свою окончательную **формулу Мистера Пробои**. Теперь я мог объяснить это в одной простой, прямой и не требующей никаких объяснений схеме, которая в то же время таила в себе глубокий скрытый смысл и огромную силу... точно так же, как этот закат!

Я тщательно проработал окончательное изображение, которое создал, поместил его в слайды презентации PowerPoint и через неделю впервые протестировал его на своей чешской аудитории в Праге.

И они не только поняли его сразу же (в течение нескольких месяцев после семинара многие стали успешными алгоритмическими трейдерами, торгующими на пробоях), но они, казалось, **полюбили** алготрейдинг.

Это **нашло свой отклик**.

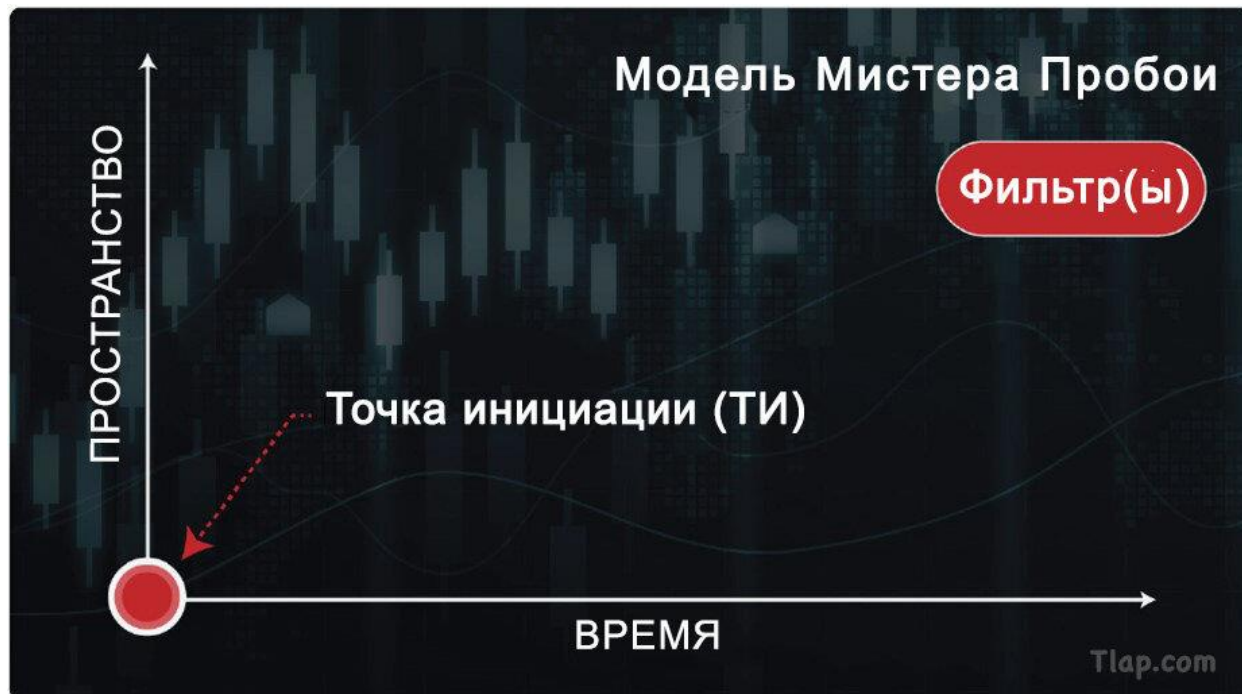
И, главным образом, это **сработало**.

Так что я знал, что всё сделал правильно.

Я знал, что это сработает. Это объяснило всё, что я делаю, менее чем за пять секунд, и все быстро поняли: «Я тоже могу это сделать!»

С того дня и до сих пор я никогда не прикасался к этому изображению... Моя формула оставалась неизменной в течение многих лет. Она по-прежнему работает и помогает бесчисленному количеству трейдеров по всему миру проводить и завершать свои собственные частные революции.

Итак, вот она, окончательно проверенная, мощная, приносящая деньги, но очень простая формула **Мистера Пробои**:



Модель Мистера Пробои
Фильтр(ы)
Пространство
Время
Точка инициации (ТИ)

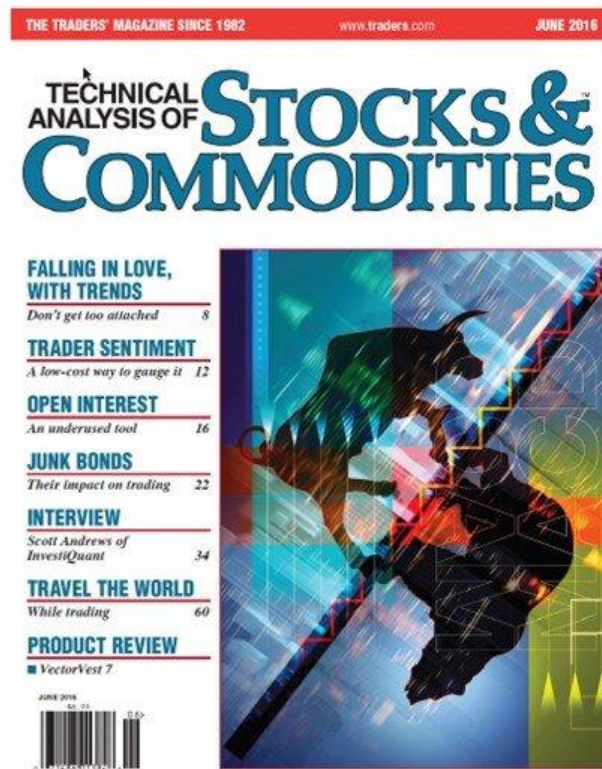
Это моя формула революции торговли на пробоях.

Благодаря этой простой формуле я наслаждался свободой, живя во многих разных странах, включая Малайзию и Испанию.

Благодаря этой формуле я путешествовал по миру с бесчисленными приключениями. Сегодня, в свои 46 лет, я посетил 65 стран. И я ещё не закончил – это далеко не весь список! Эта простая формула позволила мне жить именно той жизнью, о которой я всегда мечтал – жизнью, намного лучшей, чем всё, о чем я мог мечтать, когда рос в коммунистической Чехословакии!

И благодаря этой формуле мой торговый успех пришёл так быстро, что это начали замечать многие в финансовой индустрии.

Первая публикация пришла из дико популярного журнала "Technical Analysis of Stocks And Commodities" («Технический анализ акций и сырьевых товаров»), который имеет более 1 миллиона подписчиков из 174 стран. Сотрудник TASC взял у меня интервью, которое было опубликовано в июньском выпуске журнала 2016 года на нескольких страницах под названием «Путешествуйте по миру трейдинга с Томасом Неснидалом». Это была моя история о путешествиях по миру, полностью поддерживаемая моей формулой Мистера Пробои.



Затем со мной произошло ещё одно крутое событие. Эндрю Суюнскотт, автор одного из самых популярных подкастов по алготрейдингу Better System Trader, провёл со мной ещё одно интервью. Оно стало одним из самых скачиваемых интервью и заложило основу для большой дружбы и будущего делового партнёрства!

[Home](#)
[Courses](#)
[eBooks](#)
[Library](#)
[ET Club](#)
[BST LIVE](#)
[Leasing](#)
[About](#)

Check out some of these popular episodes:

BETTER
system trader

Hosted by Andrew Swanscott

My NEW "Breakout Trading Answered" show with BTA

Building Breakout Trading Strategies - Tomas Nesnidal

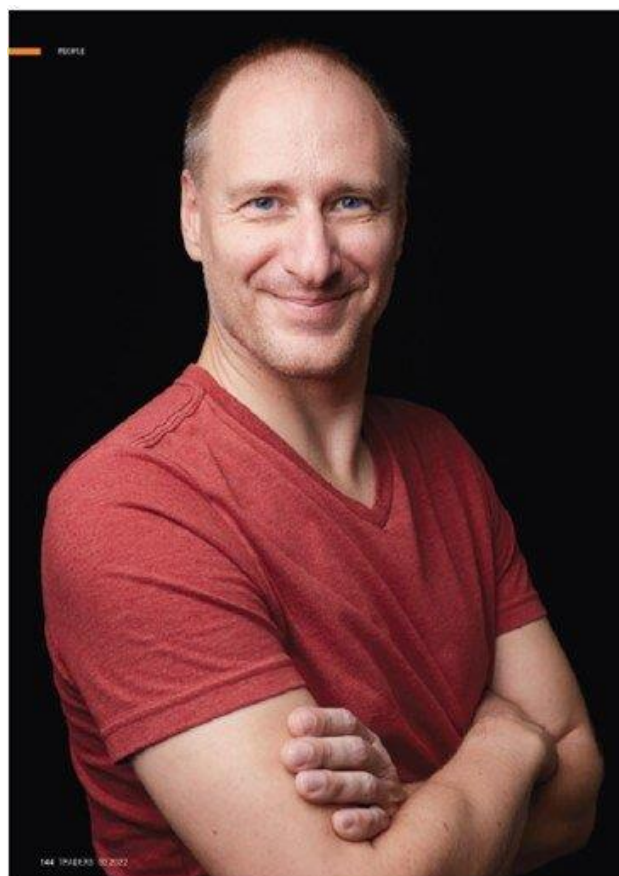
Achieving long-term trading success - Linda Raschke

Strategy Optimization with Robert Pardo

Я даже имел честь выступать вместе с Линдой Рашке и Робертом Пардо, которыми я восхищаюсь (хотя я всё ещё далек от их уровня)!

Мы с Эндрю быстро подружились. Я научил его своей формуле торговли на пробоях, и он тоже начал добиваться большого успеха, и вместе мы решили создать Академию лучшего трейдера (Better Trader Academy) для распространения революции торговли на пробоях по всему миру. (На сегодняшний день Академия лучшего трейдера имеет клиентов в 64 странах).

Мой успех также начало замечать международное торговое сообщество, и я дал несколько интервью на других языках, например, вот это длинное интервью на несколько страниц для немецкого журнала "Traders" («Трейдеры») (опубликованное в февральском выпуске журнала 2022 года):



Конечно, это только основные моменты. За эти годы я многократно появлялся в бесчисленных СМИ, посвященных трейдингу, а также на чешском национальном телевидении.

Имея такой успех и публичность, несколько лет назад я смог запустить свой собственный хедж-фонд. Это было вершиной моей карьеры в трейдинге.

Инвестиционная стратегия хедж-фонда полностью основана на моей **формуле Мистера Пробои**. Первоначально мы имели намерения основать очень маленький частный хедж-фонд для нескольких богатых друзей. Однако вскоре после того, как мы запустили свой фонд, мы встретили институционального клиента, который предложил нам очень большое обязательство инвестиционного характера, **если** мы согласимся превратить свой фонд в институциональный фонд, чтобы иметь возможность обслуживать его банкиров, пенсионные фонды, банки и семейные офисы.

Эта трансформация заняла два с половиной утомительных года (из-за совершенно безумного и кошмарного приведения нашей деятельности в соответствие с законодательными и юридическими требованиями), но в конце концов нам удалось завершить всю эту процедуру, и теперь я не могу дождаться, чтобы увидеть, куда ещё это приведёт меня.

И всё это благодаря **одной простой формуле**.
Формуле, которая завершила невероятную революцию, которая была моей жизнью.

Итак, давайте теперь посмотрим, как работает эта формула и как **Вы** можете начать использовать её для создания вашей личной революции!

Часть II. Формула

3 правила успеха в торговле на пробоях

Я знаю, что вы прямо сейчас хотите узнать все подробности об этой формуле. Это захватывающе!

Однако, прежде чем мы перейдём к ней, я должен предупредить вас: хотя сама по себе формула является крайне мощной и эффективной, она не будет работать хорошо, если вы не будете следовать трём дополнительным правилам.

Крайне важным правилам.

Это правила, ради которых я должен был «усердно работать». Мне пришлось обучиться им тяжёлым путём. На самом деле эти правила универсальны для любого успеха, но для трейдинга они являются гораздо более важными.

Пожалуйста, не повторяйте моих ошибок!

Я действительно хочу, чтобы вы преуспели. Я хочу, чтобы вы тоже построили свою собственную свободу – свою собственную жизнь, о которой вы мечтаете. И чтобы это произошло, вы должны следовать этим трём основным правилам.

Правило №1. Специализируйтесь на одном торговом подходе

Вы уже знаете, что переход от одного торгового направления к другому был одной из **худших** ошибок, которые я совершил до того, как сделал свою революцию торговли на пробоях.

Впрочем, это именно то, что многие трейдеры делают каждый день.

Моё озарение в отношении пробойного трейдинга убедило меня в том, что революция не может произойти без глубоко сфокусированного **внимания**.

Я всё больше и больше убеждаюсь, что ключевым ингредиентом **любого** успеха в **любой** сфере жизни является абсолютная концентрация внимания. Или, другими словами, достижение высокого уровня **специализации**.

Позвольте мне привести некоторые аргументы, почему я считаю, что это правда (в дополнение к моему собственному ценному опыту).

Давайте в качестве примера возьмём **врачей**.

Это, пожалуй, является самым очевидным способом доказать, как специализация тесно связана с финансовым вознаграждением.

Например, журнал Medium.com сравнил среднюю годовую зарплату врачей в США в зависимости от их специализации. Цифры говорят сами за себя.

Общая хирургия	\$382 000
Гериатрия	\$245 000
Гематология	\$372 000
Инфекционные болезни	\$265 000
Терапия	\$260 000
Медицинская генетика	\$247 000
Педиатрия	\$232 000
Неврология	\$286 000
Нейрохирургия	\$662 755
Пластическая хирургия	\$473 212
Профилактическая медицина	\$231 838
Психиатрия	\$268 000
Пульмонология	\$354 000
Радиационная онкология	\$468 000
Радиология	\$431 000
Ревматология	\$270 000
Торакальная хирургия	\$602 745
Урология	\$427 000
Сосудистая хирургия	\$382 000

Как мы видим, если вы решите стать хирургом, то худшее решение, которое вы можете принять – это стать «общим хирургом» (**без специализации**).

Хотя общий хирург по-прежнему зарабатывает в среднем \$382 000 в год, **любая** специализация значительно увеличивает его доход.

Если бы он решил стать нейрохирургом, его годовая зарплата составила бы в среднем колоссальные \$662 755. Это на 75% больше только благодаря **специализации**. И, поверьте, ваш супруг/супруга заметит и **оценит**, что вы приносите домой дополнительные \$280 000 в год!

А как насчёт других специализаций в хирургии?

Ну, торакальный хирург дополнительно приносит \$220 745 в годовой семейный бюджет (что на 58% больше благодаря **специализации**). Сосудистый хирург дополнительно зарабатывает \$94 300 (+24,7%). А пластический хирург дополнительно зарабатывает \$91 212 (+24%). Это хорошая сумма «дополнительных» денег, которые вы будете иметь на вашем банковском счёте каждый год!

Но это **ничто**.

Если вы когда-либо интересовались элитными видами спорта, вы наверняка слышали имя Джеймс Эндрюс. Он входит в двадчатку самых богатых врачей мира. Данные о его точном чистом капитале варьируют, но, по мнению многих, он составляет до \$100 миллионов.

Как он сколотил такое состояние, являясь исключительно практикующим врачом?

Он **специализируется**.

Но не в области медицины.

Он специализируется на клиентуре, которую обслуживает. Он решил специализироваться исключительно на **спортсменах**.

Это означает, что он не работает с другими клиентами, кроме спортсменов. Он даже открыл Центр спортивной медицины и ортопедии Эндрюса. Теперь благодаря своей специализации он является выбором номер один для спортсменов во всех видах спорта и служит врачом для таких команд, как Auburn Tigers, Alabama Crimson Tide и Washington Commanders Национальной футбольной лиги (НФЛ).

Он использовал **специализацию** для создания огромного состояния, и я очень сомневаюсь, что будучи практикующим врачом общего профиля, доступного любому, он когда-либо заработал бы больше, чем посредственную зарплату в сравнении с этим доходом.

Это потому, что специализация окупается – **огромным образом!**

Давайте продолжим. Позвольте мне задать вам вопрос:

«Знаете ли вы, кто самый богатый режиссёр на планете?»

Большинство людей думают, что это Стивен Спилберг. Да, он действительно **очень** богат. За свою долгую кинокарьеру он снял более 50 фильмов и спродюсировал более 100, но он **не** самый богатый режиссёр. Он один из лучших, но поскольку он не специализируется ни в одном из жанров или видов кино, он не является самым богатым.

Самым богатым режиссёром за всю историю является парень, который специализируется. Его состояние оценивается в \$5,1 миллиардов, и за всю свою кинокарьеру он снял всего 5 фильмов.

Не 50.

А всего пять.

Его зовут Джордж Лукас. Его специализация – «Звёздные войны». Одна специализация на всю жизнь = огромное состояние.

Конечно, вы можете подумать, что этот пример немного преувеличен, но многие другие заработали целые состояния в Голливуде благодаря **специализации**.

Режиссёр Майкл Бэй стал колоссально богатым благодаря своим очень громким, взрывным, быстро развивающимся фильмам. Это и есть его специализация. Он не пытается режиссировать мюзиклы, комедии или драмы, удостоенные премии «Оскар». Он режиссирует такие фильмы, как «Трансформеры», «Скала» или «Армагеддон». Его специализация – эти ультра-большие, ультра-громкие постановки. За это ему платят кучу денег. В настоящее время Бэй является пятым самым богатым режиссёром в Голливуде.

Давайте поговорим о самом богатом кинорежиссёре. Его зовут Питер Джексон. Можете ли вы вспомнить какой-нибудь из его фильмов, кроме «Властелина колец»? Я тоже учился в киношколе. Да, это его специализация.

Но подождите, возможно, вы подумаете, что у меня предвзятое отношение и что я выбираю очевидные исключительные случаи. Итак, давайте углубимся в художественные фильмы.

Как вы знаете, некоторые фильмы очень редко окупаются. Отдельные жанры фильмов делают вас голодающим художником с множеством причудливых, но бесполезных художественных наград на стенах вашей маленькой темной арендованной квартиры. Верите вы или нет, но специализация относится и к «художникам-постановщикам». И даже в художественных фильмах **специализация** может приравниваться к небольшому состоянию.

Возможно, вы подумаете, что все эти странные невротические низкобюджетные фильмы режиссера Вуди Аллена едва ли принесли ему прибыль. (Когда я был в кинотеатре на просмотре его последних фильмов, я, как правило, был единственным зрителем в зале!)

Но это было бы неправильным предположением.

На самом деле эти забавные странные фильмы тоже являются очень точной формой **специализации**. Никто больше не снимает такие фильмы, поскольку Вуди Аллен создал свой собственный невротический стиль.

И по этой причине он является 23-м самым богатым кинорежиссёром в мире с чистым капиталом около \$100 миллионов. Без всяких шуток. Потому что даже странная специализация – это тоже специализация..., и она может принести вам кучу денег.

Я мог бы продолжить приводить ещё много подобных примеров, но давайте наконец поговорим о трейдинге.

Одним из самых известных трейдеров в истории трейдинга является Эд Сейкота. Если вы читали книгу «Маги рынка», то знаете, что для одного из своих друзей он превратил \$5 000 в \$15 миллионов.

Как?

Разумеется, благодаря **специализации**.

Специализация Сейкоты заключается в следовании тренду на фьючерсных рынках. Никаких причудливых алгоритмов. Ни Форекса, ни биткойна. Никаких других торговых стилей, подходов или направлений. Просто старое доброе следование за трендами, применяемое к фьючерсам.

Эд Сейкота также обучил других трейдеров этой узкой **специализации**. Одним из них является Брюс Ковнер, который сам стал специалистом по трендам и чей капитал на сегодняшний день составляет \$3,5 миллиарда. Неплохо, правда?

Конечно, в трейдинге есть и много других специализаций. Давайте поговорим ещё о нескольких.

Роберт Пардо – один из самых известных трейдеров. Он работает в этом бизнесе уже более 40 лет, а его фонд Pardo Capital завоевал множество наград.

Специализация Роберта – **форвардный анализ**. Он изобрёл этот метод, став в нём настоящим **специалистом**, и теперь он и его клиенты наслаждаются плодами этой **специализации**.

Или, возможно, вы слышали имя Тони Салиба. Этот парень известен тем, что был прибыльным в течение 70 месяцев. (Только представьте: шесть лет подряд зарабатывать деньги каждый месяц, без единого убытка.)

Более того, каждый из этих 70 месяцев Салиба показывал прибыль не менее \$100 000. Феноменально!

Как ему это удавалось?

У Тони всего лишь одна **специализация**: торговля опционами. Он не переходил от одного стиля торговли к другому и не пытался понять все на свете, ничего не делая в результате.

Достаточно **одной-единственной вещи**.

Думаю, теперь вы поняли.

Если вы хотите добиться успеха в трейдинге, то **специализируйтесь** только на одном подходе.

Я окончательно решил стать специалистом в алгоритмическом трейдинге на пробоях (и даже получил псевдоним «Мистер Пробои»).

Вы тоже можете стать специалистом по пробойному трейдингу, вам ничто не препятствует. Эта книга поможет вам пройти долгий путь в правильном направлении!

Но если вы решите специализироваться на пробойном трейдинге, вам лучше быть готовым придерживаться его. Я серьёзно. По крайней мере в течение нескольких лет, пока вы действительно не освоите его.

Это действительно окупается.

Именно так вы опережаете всех остальных.

Это будет ваш самый большой будущий актив...

Специализация.

Глубоко разбираться только в одной области, вместо того чтобы быть посредственным в нескольких вещах.

Переход от одного фокуса к другому не работает. По крайней мере, если речь идёт о трейдинге.

Правило №2. Мыслите глобально

Если вы хотите создать **настоящий** бизнес по торговле на пробоях, вам нужно кое-что понять. Кое-что, что является ещё одной важной частью моего торгового успеха и незаменимым аспектом многих других успешных видов деятельности.

Большинство хороших видов деятельности в современном мире имеют схожую общую стратегию роста: я называю это **глобальным воздействием**.

Любой, у кого есть здравая проверенная идея, хочет быть **везде**. На всех возможных рынках, в каждой возможной стране или регионе.

И, поверьте мне, обычно дело **не только** в прибыли.

Самой большой причиной этих глобальных стратегий воздействия зачастую является нечто другое...

Диверсификация.

Только представьте, что сделала бы такая компания, как Starbucks, в сегодняшних условиях, если бы их единственным рынком был российский. (Я пишу об этом, поскольку Россия продолжает атаковать Украину, и в результате большинство мировых компаний в настоящее время уходят с российского рынка).

Они будут бороться за выживание, вместо того чтобы продолжать массовый рост во всём мире!

Сегодня каждая компания знает, что **глобальное** присутствие не только означает потенциал для получения максимальной прибыли, но и значительно снижает общий коммерческий риск. Хорошая **диверсификация** между различными странами и регионами смягчает многие риски локальных и региональных (даже глобальных) кризисов, нестабильности, экономических потрясений и неожиданных событий, таких как цунами или землетрясения.

Именно это является следующим правилом, которое вам нужно применить к вашему торговому бизнесу.

После того, как вы докажете свою концепцию «локально» (то есть только на нескольких рынках), вам нужно начать думать и действовать «глобально». Вам нужно начать экспансию на другие рынки. Вместо того, чтобы увеличивать количество торгуемых контрактов, как это делают большинство трейдеров, пытаюсь масштабироваться, сначала убедитесь, что вы растёте как можно более «глобально».

Я называю этот подход «систематизацией».

Экспансия на несколько рынков, использование всё новых и новых стратегий – в идеале как можно более некоррелированных – является вашей самой надёжной «глобальной» стратегией, которую вы должны установить и очень серьёзно следовать ей.

Это также является точной причиной, почему я не торгую на рынке Форекс или криптовалютном рынке (хотя с моей формулой торговли на пробоях я определённо мог бы торговать и на них).

Я торгую на фьючерсных рынках исключительно потому, что для создания действительно глобального торгового бизнеса **лучших рынков** просто не существует. Фьючерсные контракты обеспечивают самый сложный уровень диверсификации среди множества сильно некоррелированных рынков, что, в свою очередь, позволяет мне **хеджировать** свой доход от торговли на пробоях против будущих неизвестных.

Эта «глобальная стратегия» является моей конечной **политикой хеджирования**. На фьючерсных рынках я могу достичь уровня диверсификации, о котором трейдеры валютного или криптовалютного рынка могут только мечтать. Эта диверсификация необходима для преодоления волатильности, которая разрушает торговые счета на одном рынке и разоряет подавляющее большинство трейдеров на валютных и криптовалютных рынках.

Кроме того, мне очень нравится жёстко регулируемая среда фьючерсных рынков. (К сожалению, не могу сказать этого о рынке Форекс или криптовалютном рынке, и у меня есть масса подтверждений на этот счёт.)

Этот подход вы лучше всего можете применить на меньших счетах благодаря недавней инновации фьючерсного рынка под названием «микрофьючерсы». Почти каждый может торговать фьючерсами с помощью этих небольших контрактов и строить свою «глобальную империю», начиная со скромного капитала.

Неудивительно, что именно «глобальная стратегия» является тем самым подходом, который я использовал в своей собственной торговле, а также в своем хедж-фонде.

Как только я доказал свою формулу торговли на пробоях и структуру разработки стратегии буквально на нескольких рынках (в основном на индексах), я, естественно, начал разветвляться в «глобальном» масштабе. Я начал применять ту же проверенную пробойную модель и структуру к другим секторам рынка... К рынкам энергии, зерна и металлов. Со временем я

расширился на такое количество будущих рынков, на скольких я мог найти хорошие стратегии, включая валютный рынок, европейские рынки, облигации, ПО и мясо.

Медленно, шаг за шагом, в полном соответствии с суперуспешными компаниями, такими как Starbucks, я построил свой глобальный бизнес.

Именно так мы разработали более 2000 стратегий в моём хедж-фонде.

Этот подход имеет большой смысл по двум причинам. Во-первых, мы сделали это, потому что **могли** это сделать. С моей формулой это вполне осуществимо. А во-вторых, мы сделали это просто ради роскоши иметь достаточное количество пробойных торговых стратегий, чтобы разработать наилучшие возможные портфели, чтобы обеспечить автоматизированный доход от трейдинга, в любой экономике и при любых обстоятельствах.

И последнее.

Правило №3. Развивайте свой творческий потенциал

Красота формулы Мистера Пробои заключается в том, что с её помощью вы можете развить свой творческий потенциал.

Это является **лучшей новостью**, потому что означает, что она никогда не потерпит неудачу. На ней невозможно «торговать излишне», сколько бы многие трейдеры не использовали её аналогичным образом, подвергая свои стратегии риску неудачи. Поскольку каждый трейдер будет применять эту формулу по-разному, внедряя в неё свои собственные идеи, все эти вариации исключают возможность провала данной формулы.

Это действительно самая гениальная вещь в формуле: она бесконечно масштабируема – настолько, что я мог бы научить ей каждого трейдера в мире, и она бы всё равно не подвела!

Как только вы начинаете вкладывать в неё **немного** творчества, вы сразу же приобретаете «свою собственную версию» и тем самым практически исключаете вероятность того, что формула не будет работать для вас. (Я торгую с помощью этой формулы уже более десяти лет, и могу вас заверить, что на сегодняшний день она работает так же хорошо, если даже не лучше, чем в первый день.)

Но вы должны проделать работу.

Вы должны быть готовы немного подумать: достать ручку и бумагу и провести мозговой штурм своих собственных идей. Только от вас самих зависит, наполнять ли эту формулу вашими собственными свежими идеями, чтобы она продолжала помогать вам двигаться вперёд и получать прибыль.

И вы захотите сделать это весело.

В следующих главах я покажу вам, что **именно** я имею в виду под «творчеством», и даже укажу точные области для вашего прикладного творчества, чтобы вы знали, какую часть формулы следует проработать в процессе «нестандартного» мышления.

Не считайте это препятствием. Принимайте это как подарок, как огромную возможность... потому что это то, что есть!

Творчество – это весело. У всех нас есть творческая сторона. Нам просто нужно использовать её, потому что эта часть мозга удивительна и красива.

Ничто в жизни не является какой-то одной изолированной наукой, включая трейдинг.

Поддержание хорошего потока жизни зависит от баланса. Хороший поток дохода в трейдинге зависит от хорошего баланса между левым и правым полушариями вашего мозга.

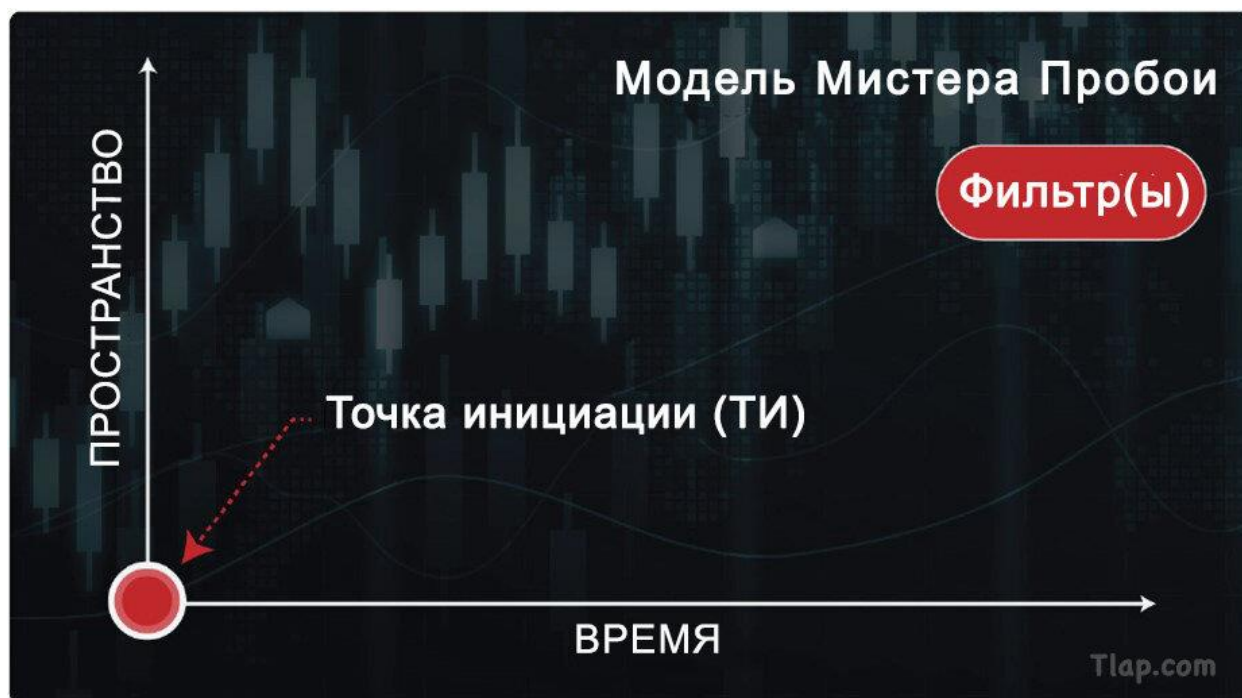
Как **удивительно** и **захватывающе**!

Теперь, когда вы знаете 3 «золотых правила», мы можем, наконец, непосредственно перейти к анализу самой формулы.

Точка инициации

Теперь поговорим о формуле. Можем начать с того, что вернёмся к схеме, которой я только что поделился.

Просто посмотрите на это изображение и задумайтесь над ним в течение нескольких секунд:



Модель Мистера Пробои
Фильтр(ы)
Пространство
Время
Точка инициации (ТИ)

Что вы уже можете увидеть и понять здесь?

Ну, позвольте мне немного разбить его для вас на более простые фрагменты и прежде всего поговорить о том, что определяет торговый пробой. Вот ключевые принципы торговли на пробоях, которые вам нужно уяснить:

1. Рыночный пробой **всегда** происходит в **пространстве** и **времени**. Это самая важная часть для понимания.
2. Однако, чтобы точно определить оптимальное пространство, нам нужно вычислить его из некоторой начальной точки. Итак, нам нужна **точка инициации (ТИ)**.
3. Когда мы берем **точку инициации** и добавляем или вычитаем **пространство**, мы получаем **уровень пробоя**.

4. Однако для построения жизнеспособной и надежной стратегии торговли на пробоях одного лишь расчёта **уровня пробоя** недостаточно. Чтобы уменьшить частоту ложных пробоев – необходимое условие для прибыльной торговли – нам также необходимо включить один или несколько соответствующих **фильтров**.
5. И поскольку хорошая торговля – это правильное время, нам также нужно учитывать и **время**. Работа с временными параметрами позволяет нам ещё больше улучшить время входа в рынок.

Итак, чтобы построить стратегию торговли на пробоях, нам нужны четыре компонента:

- **Точка инициации,**
- Расчёт **пространства,**
- Оптимальное **время** для входа в сделку и
- Соответствующий(ие) **фильтр(ы)**.

Довольно просто, не так ли?

Вопрос: удалось ли вам осознать всё это самостоятельно, просто изучив эту схему? Если да, поздравляю! Вы уже сделали первый шаг к становлению специалистом по пробойному трейдингу!

Давайте продолжим.

Помимо этой простой 4-компонентной модели вы также должны понимать, что в торговле на пробоях мы всегда будем использовать для наших входов **стоп-ордер**. Это ещё одна важная часть формулы Мистера Пробои.

Если вы не знаете, что такое **стоп-ордер** (также иногда называемый **рыночным стоп-ордером**), вот довольно хорошее объяснение от Чарльза Шваба:

Что такое стоп-ордер и как он используется?

Стоп-ордер – это ордер на покупку или продажу акций по рыночной цене после того, как акция торгуется по указанной цене или прошла через нее [U1] («стоп-цена»). Если акция достигает стоп-цены, ордер становится рыночным ордером и исполняется по следующей доступной рыночной цене. Если акция не достигает стоп-цены, ордер не исполняется.

Стоп-ордер может быть уместен в следующих сценариях:

- Когда акция, которой вы владеете, выросла в цене, и вы хотите защитить свою прибыль, если её цена начнет падать
- Когда вы хотите купить акцию на пробое выше определённого уровня, полагая, что она продолжит расти

Стоп-ордер важен, потому что позволяет нам разместить ордер на вход в рынок **заблаговременно**. Это означает, что как только компьютер рассчитывает желаемый **уровень пробоя**, он автоматически размещает **стоп-ордер** на этом конкретном уровне, и как только рынок достигает данного **уровня пробоя**, немедленно инициируется соответствующая позиция (длинная или короткая).

Однако, прежде чем мы перейдём к этой точке, нам нужно рассчитать **уровень пробоя**.

Как именно мы это делаем?

Нам просто нужно установить некоторую **точку инициации** (ТИ), а затем добавить или вычесть из неё некоторое **пространство**. Более детально о **пространстве** мы поговорим в следующей главе. На данный момент давайте начнём только с **точки инициации** (ТИ).

Мы уже знаем, что с нашей формулой торговли на пробоях мы должны где-то начать, верно?

Но **где именно?**

Потрясающая истина состоит в том, что... на самом деле это не имеет значения!

Это правило **креативности**, применяемое к ТИ. С помощью ТИ мы можем протестировать **всё что угодно**. Здесь нет понятия правильного или неправильного; просто разные идеи принесут нам разные результаты.

Например, вы можете использовать **цену открытия** сегодняшнего дня.

Или **цену закрытия** вчерашнего дня.

Или **цену минимума** сегодняшнего дня.

Или **цену максимума** сегодняшнего дня.

Итак, простая строка кода, представляющая точку инициации, может выглядеть так:

POI = CloseD(1)//Yesterday's Day Close in TradeStation
Or
POI = OpenD(0)//Today's Day Open in TradeStation

И я могу легко добавить сюда ещё много чего. Как я уже сказал, **не** имеет **значения**, с какой ТИ вы начинаете. Просто соберите несколько идей и протестируйте их все.

Подойдет **любая** простая или даже сложная идея.

И разные идеи дадут разные результаты.

Это ваша работа: запустить творческую составляющую вашего мозга и подумать о том, что ещё может служить потенциальной ТИ. (Я уже дал вам руководство.)

Это не должно выглядеть слишком сложно, особенно если вы уже некоторое время занимаетесь торговлей. Вы должны **легко** придумать по крайней мере пять дополнительных идей касательно вашей ТИ прямо сейчас. Пожалуйста, возьмите ручку и запишите их:

Идея касательно моей ТИ №1: _____
Идея касательно моей ТИ №2: _____
Идея касательно моей ТИ №3: _____
Идея касательно моей ТИ №4: _____
Идея касательно моей ТИ №5: _____

Как видите, это очень легко! И вы уже применяете одно из трёх правил успешной торговли на пробоях – **креативность**!

Всегда тестируйте разные идеи для ТИ – тестируйте разные их комбинации. Здесь вы можете проявить **творческий** подход.

Например, как только вы протестируете основные идеи, такие как рыночную цену открытия сегодняшнего дня – в TradeStation она пишется как `OpenD(0)` – и рыночную цену закрытия вчерашнего дня – в TradeStation она пишется как `CloseD(1)`, – вы можете объединить их вместе и использовать в зависимости от того, какая из них **выше** или **ниже**.

В TradeStation это выглядит так:

`POI = MinList (OpenD(0), CloseD(1))`

`POI = MaxList (OpenD(0), CloseD(1))`

Опять же, возможности здесь в буквальном смысле бесконечны!

Что делать, если вы торгуете на рынках, которые торгуются в режиме 24/7, например, на рынке Форекс?

В этом случае вы можете использовать **другой вид** ТИ – тот, который не зависит от времени открытия или закрытия. Например, вы можете использовать скользящие средние или некоторые типы полос, такие как **полосы Боллинджера**.

Или нанесите на график **объём** и понаблюдайте, есть ли определённое время дня, когда объём резко увеличивается. Когда вы увидите, что это происходит в большинстве дней или в определённые дни недели в виде регулярного паттерна, значит, у вас есть пригодная для тестирования ТИ. Затем вы можете использовать это в качестве цены открытия дня, потому что во время этих повторяющихся всплесков объёма многие трейдеры выходят на рынок. В каком-то смысле это можно считать «неофициальной» ценой открытия дня.

Или, если вы работаете в TradeStation, используйте временные шаблоны.

Опять же, **всегда** есть какое-то решение, **всегда** есть какая-то идея. Не бойтесь экспериментировать и проявлять творческий подход!

Применяя **любой** вид ТИ для вашего тестирования, вы не **можете** ошибиться.

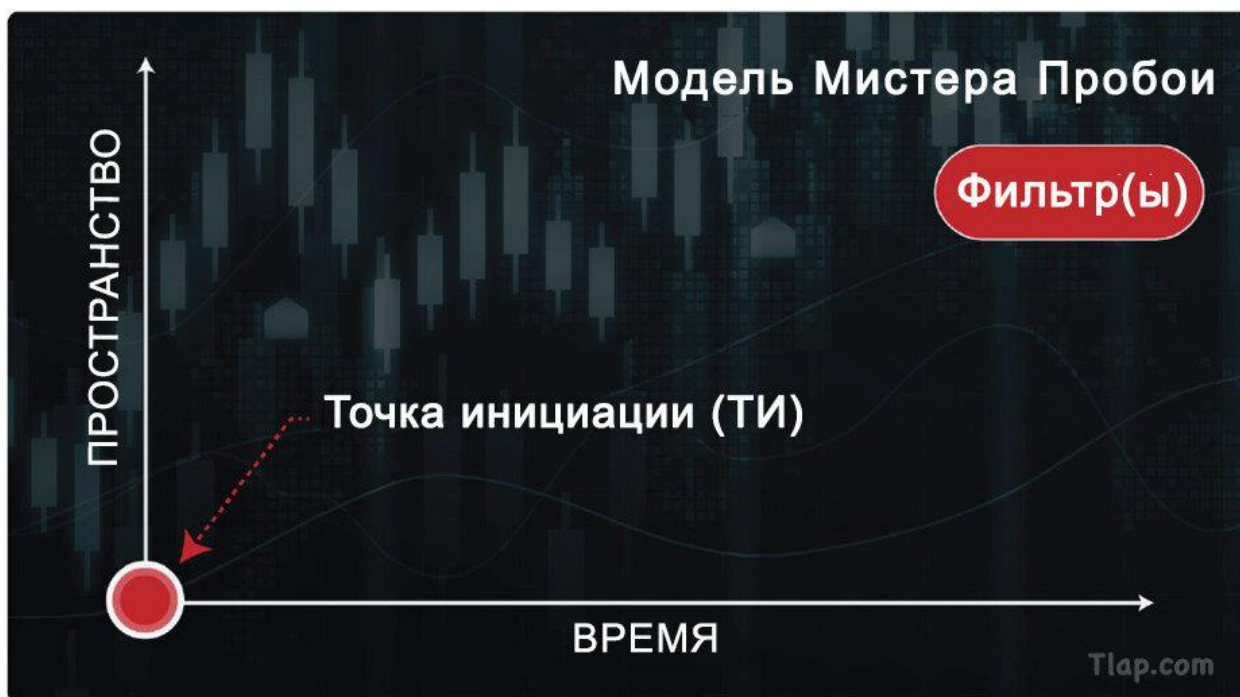
Это самый гибкий компонент формулы Мистера Пробои!

Ок, это понятно?

Отлично. Тогда давайте перейдём к **пространству**.

Индикатор Святого Грааля

Теперь, когда у нас есть точка инициации, мы можем начать вычислять фактический **уровень пробоя**, добавляя или вычитая компонент, называемый **пространством**:



Модель Мистера Пробои
Фильтр(ы)
Пространство
Время
Точка инициации (ТИ)

Этот шаг является крайне простым, и мы реализуем его с помощью того, что я называю «индикатором Святого Грааля».

Но прежде чем мы перейдём к нему, я хочу поделиться с вами короткой историей, чтобы дать вам немного перспективы.

После бархатной революции 1989 года, когда мы, наконец, стали независимыми от Советского Союза, и бывший СССР начал распадаться, многие россияне воспользовались этим огромным хаосом (это выглядело как полная анархия для меня) и строили некоторые серьёзные предприятия.

В период с 1989 по 1991 год во время распада Советского Союза российский чёрный рынок переживал невероятные времена. Там можно было купить самые невероятные вещи, в том числе ракеты и атомные подводные лодки. И это без всяких шуток. (Известный чешский репортёр однажды снял об этом шокирующий документальный фильм.) Такие вещи были совершенно нормальными в то сумасшедшее время.

И, естественно, эта «традиция» российских чёрных рынков продолжается и сегодня. Она просто переместилась в Интернет. (И я держу пари, что вы по-прежнему можете купить там атомную подводную лодку!)

Теперь я должен признаться и поделиться с вами тем, чем я не так сильно горжусь, но тем не менее рад, что сделал это.

Во время моих поисков «правды» о том, что действительно работает на рынках и как построить окончательную прибыльную стратегию, как и многие другие, я обратился за помощью к российскому чёрному рынку.

Каким-то образом мне удалось найти россиянина, который утверждал, что у него есть исходные коды для нескольких высокодоходных стратегий, которые можно было арендовать в то время.

Я был заинтригован идеей заполучить их в свои руки и узнать «секрет» этих успешных стратегий, поэтому я рискнул и отправил \$300 тому, кто знает, где их можно взять (инструкции по оплате были сумасшедшими), и очень надеялся, что это не было простым мошенничеством (хотя на самом деле я практически был уверен в этом).

Но, к моему удивлению, я таки получил обещанный жёсткий диск с **большим количеством** торговых вещей, программного обеспечения и кодов. Там были и обещанные стратегии, **полностью** раскрытые моему любознательному уму.

Я не мог в это поверить. Я почувствовал смесь глубокой вины и детской радости, и сразу же начал деконструировать все эти стратегии.

И я многому научился!

С одной стороны, стратегии были до боли элементарными. Я был удивлен их простотой. Ничего необычного, ничего сложного и ничего «нестандартного».

Но в основном все они имели какую-то волатильную составляющую!

В качестве самого важного элемента они использовали индикатор ATR (Average True Range) или TR (True Range), и очень быстро я понял, что **это** действительно волшебный индикатор.

Вот формула для ATR:

Формула среднего истинного диапазона (ATR)

Первым шагом в вычислении ATR является поиск серии истинных значений диапазона для актива. Ценовой диапазон актива для данного торгового дня – это просто разница между его максимумом и минимумом. Между тем истинный диапазон является более всеобъемлющим и определяется как:

$$TR = \text{Max} [(H - L), \text{Abs}(H - C_p), \text{Abs}(L - C_p)]$$

$$ATR = \left(\frac{1}{n}\right) \sum_{(i=1)}^{(n)} TR_i$$

где:

TR_i = конкретный истинный диапазон

n = используемый период времени

Всё это имело смысл.

Задумайтесь. На что постоянно жалуются трейдеры? На **волатильность**.

Волатильность никогда не бывает идеальной. Либо она слишком высокая, либо слишком низкая. Цена актива торгуется либо в слишком узком диапазоне, либо в слишком сумасшедшем. Слишком внезапно или слишком скучно.

Трейдеры **никогда не** довольны волатильностью, потому что она постоянно меняется. И это, естественно, делает трейдеров небезопасными (включая меня).

Алготрейдеры любят фиксированные, статистически стабильные константы. Но волатильность **не** является фиксированной.

Как в таком случае мы решаем этот вопрос?

Очень легко:

Вы должны сделать волатильность **ключевой частью вашей торговой стратегии**.

Проще говоря, некоторые части вашей торговой стратегии всегда должны отражать волатильность.

Это было очень важное открытие, которое благодаря моим инвестициям на чёрном рынке в размере \$300 помогло мне выяснить компонент **пространства** и, следовательно, лучший способ рассчитать окончательный **уровень пробоя**.

Так в чём же секрет? На самом деле всё довольно просто.

1. Возьмите точку инициации (по вашему выбору).
2. Добавьте к ней волатильность, чтобы рассчитать **уровень для открытия длинной позиции на пробое**.
3. Вычтите из неё волатильность, чтобы рассчитать **уровень для открытия короткой позиции на пробое**.
4. Сделайте это всё, используя индикатор Average True Range (индикатор Святого Грааля).

Именно так:



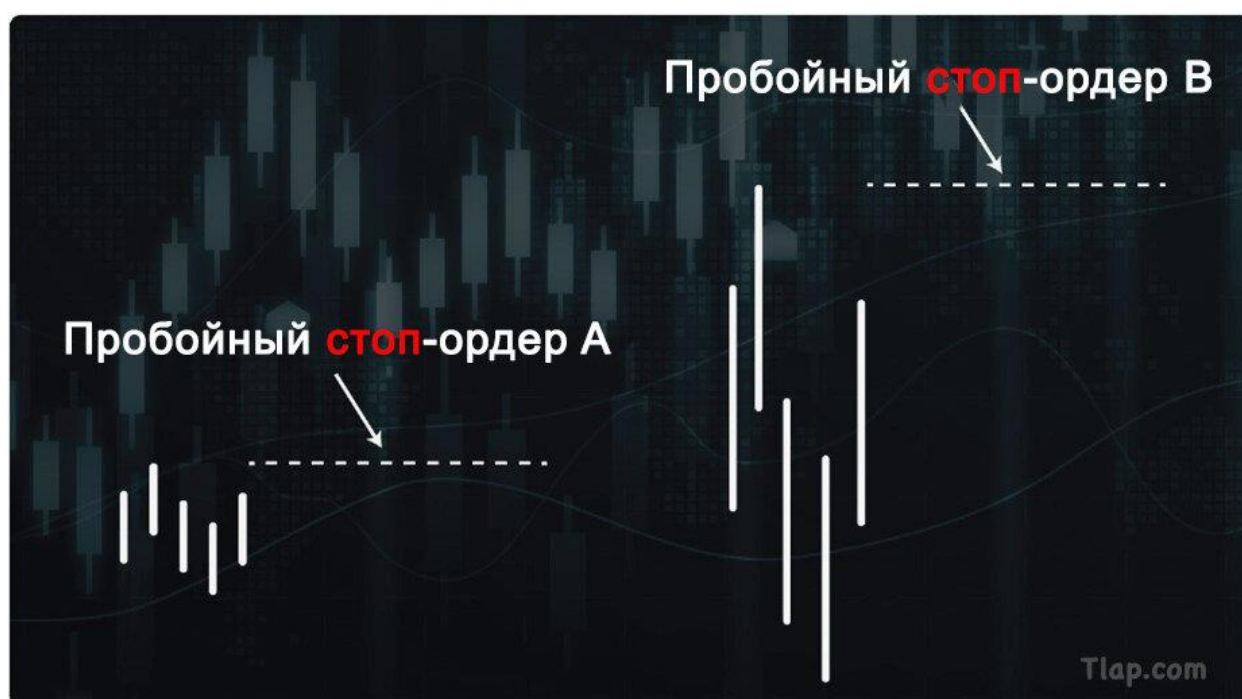
ТИ
Уровень для открытия длинной позиции на пробое
ТИ + волатильность
ТИ - волатильность

Уровень для открытия короткой позиции на пробое

Теперь посмотрим, что происходит, когда вы используете волатильность (индикатор ATR Святого Грааля) для расчёта уровней пробоя:

1. Когда на рынках низкая волатильность, ваши уровни входа на пробое будут ближе к фактической рыночной цене. Это именно то, чего вы хотите. И...
2. Когда на рынках наблюдается высокая волатильность, вы будете устанавливать ваши уровни входа на пробое дальше от текущей цены, чтобы избежать опасных и затратных зигзагообразных ценовых движений.

Слева на рисунке показана низкая волатильность с близко расположенным **уровнем пробоя**, а справа – высокая волатильность с более отдалённым **уровнем пробоя**:



Пробойный стоп-ордер А
Пробойный стоп-ордер В

Другими словами, на рынках с низкой волатильностью вы не хотите, чтобы ваш уровень пробоя был слишком далеко от текущей рыночной цены. Иначе вы не захватите достаточного ценового движения, чтобы получить разумную прибыль и сохранить положительное соотношение прибыли к риску.

С другой стороны, на рынке с высокой волатильностью вы будете устанавливать свой уровень пробоя дальше от текущей рыночной цены (пробойный стоп-ордер В), иначе будете рисковать слишком частыми срабатываниями ваших ордеров стоп-лосс.

И именно так вы развёртываете следующий компонент формулы Мистера Пробоя для расчета **пространства** для ваших сделок. (Для справки: иногда я также называю его **расстоянием**. Если вы когда-нибудь услышите, как я говорю «расстояние», это означает то же самое, что и «пространство»... Это два синонимичных термина для одного и того же компонента формулы Мистера Пробоя.)

Ваше пространство всегда будет кратным текущей волатильности.

В практике кодирования это выглядит так:

$LONG\ BREAKOUT\ ENTRY\ LEVEL = POI + (AverageTrueRange(25) * FRACT)$
 $SHORT\ BREAKOUT\ ENTRY\ LEVEL = POI - (AverageTrueRange(25) * FRACT)$

Фрактал, естественно, **должен** быть оптимизирован. Более детально об оптимизации мы поговорим в следующей главе.

Для периода среднего истинного диапазона (ATR) в нашем хедж-фонде мы обычно используем значения 5, 25 или 40. Нет необходимости их оптимизировать. (Как вы в дальнейшем узнаете, вам следует ограничить количество входных параметров для оптимизации.)

Теперь последний вопрос, касающийся **пространства**:

Нужно ли использовать более креативный способ?

Ответ: нет.

Это самый простой, универсальный и мощный способ вычисления **пространства**, который я когда-либо находил. Он идеально адаптируется к последним изменениям волатильности, делая именно то, что я ожидаю. (И я также обнаружил, что эта вещь, созданная на российском чёрном рынке, была правильной.)

Он **работает** просто. Он работает десятилетиями, и я уверен, что он будет работать и в будущем.

Итак, теперь вы понимаете, что такое **пространство**, вы изучили индикатор Святого Грааля и даже можете рассчитать фактические уровни пробоя.

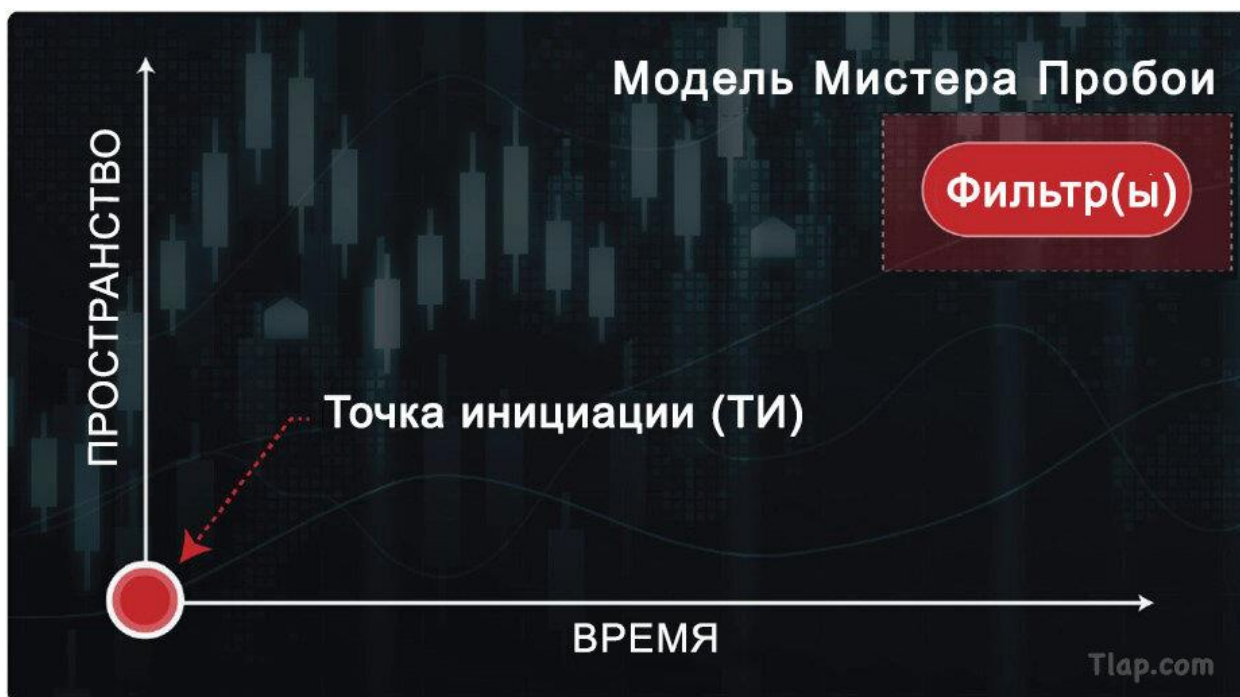
Теперь давайте поговорим о **фильтрах**.

Фильтр(ы)

Теоретически вы должны уметь создавать пробойную торговую стратегию, просто выяснив несколько мощных ТИ, правильное количество **фракталов** в расчёте **пространства**, а затем завершив её установкой разумных ордеров стоп-лосс и тейк-профит (или любого другого вида выхода из рынка).

Однако на практике эти чрезмерно упрощённые модели никогда не работают должным образом. По моему опыту, стратегии без фильтра всегда очень быстро терпели неудачу и приводили к потере денег.

Итак, хотя я тоже когда-то был заинтригован простотой этого подхода «только ТИ и **пространство**» и даже смог запустить несколько мощных визуальных 3D-оптимизаций, очень быстро стало очевидно, что в целом эта формула **всегда** нуждается в фильтре/фильтрах:



Модель Мистера Пробои
Фильтр(ы)
Пространство
Время
Точка инициации (ТИ)

И когда я говорю «**всегда**», я имею в виду именно это. Есть несколько причин, почему это так:

1. Простая модель без использования фильтра дает слишком много ложных пробоев.
2. Она также приводит к слишком большому количеству сделок.
3. И вследствие двух предыдущих пунктов средняя сделка почти всегда является слишком низкопродуктивной, чтобы назвать данную стратегию жизнеспособной.
4. Более того, стратегии пробоя **без** использования фильтра просто плохо работают на реальном рынке (в режиме реального времени) за пределами выборки.

Чрезмерное упрощение не работает в трейдинге. Всегда должен быть разумный баланс. Поэтому ваши стратегии торговли на пробоях **всегда** нуждаются в каком-то фильтре.

Теперь вы, возможно, спросите:

«**Какой** же фильтр следует использовать?»

Это **неправильный** вопрос.

С фильтрами, как мы видели при рассмотрении ТИ, вам нужно попробовать много разных подходов, чтобы выяснить, что работает на том или ином рынке и таймфрейме.

Вопрос, **какой** именно фильтр следует использовать, на самом деле не является важным. Гораздо более важным является вопрос:

Сколько фильтров следует использовать?

И мне потребовалось **очень** много времени, чтобы выяснить это.

Потому что самый простой способ – наложить множество фильтров друг на друга. Это выглядит красиво на исторических данных, но в итоге вы получаете полностью перегруженную, подогнанную стратегию, которая терпит неудачу с первого же дня на вашем реальном торговом счёте.

Чрезмерная аппроксимация и оптимизация – это ошибка номер один, которую постоянно совершают начинающие алготрейдеры.

Одержимые идеей получения лёгких денег, они просто «подгоняют» свои отчёты по результатам бэктестирования настолько тщательно, что в реальной торговле у них не остаётся места даже для малейшей возможности выживания.

На заре своей торговой деятельности я тоже совершал подобное «преступление». Раньше я создавал стратегии с четырьмя или пятью фильтрами, в результате чего обманывался невероятными кривыми капитала при тестировании на исторических данных, а затем терял деньги со скоростью света, как только применял эти стратегии на своём реальном счёте.

В связи с этим, пребывая на пике своего разочарования, я решил удалить **все** фильтры. Я начал экспериментировать только с «простыми» пробойными моделями без применения каких-либо фильтров. И, как вам уже известно, это мне тоже не удалось.

Итак, затем я снова вернулся к использованию фильтров, но на этот раз сократил количество до одного или двух. Это определённо сработало лучше, но я всё ещё чувствовал большую неуверенность. Мне нужно было получить **количественный** ответ о том, **сколько** фильтров я могу безопасно использовать и **сколько** из них порождает чрезмерный риск.

Вот урок о мыслительном процессе трейдера: я начал с интуитивного понимания, а затем выстроил свой окончательный подход на твёрдой научной основе.

К счастью, эта неопределённость изменилась в первые дни существования моего хедж-фонда, когда мы решили провести обширное исследование и, наконец, решить этот загадочный вопрос «**сколько**».

Давайте сначала поговорим о методологии, которую мы использовали для проведения этого исследования.

В то время у нашего хедж-фонда было более 700 различных стратегий торговли на пробоях. Большинство из них были разработаны для фьючерсных рынков и охватывали как внутридневные таймфреймы, так и таймфреймы для свинг-трейдинга. Все они прошли наши тесты на надёжность и соответствуют требованиям к качеству в реальной торговле.

Workflow Database

Home

Details

Admin

Login

Logout

Main Table

Big Picture

IPython Jupyter

Analysis

Portfolio

Welcome tomnes!

Count: 700

Export to Excel

First < 1 of 15 > Last

Select Filter

All candidates: no filter

Records: 368

Candidate

CID	Tags	Created	Symbol	TF	Style	LSB	Order Type	No.Trades	IECP %	DHIDX	Bundle	CA		BSP	
												Rings %	Rings Metric	Fix Criteria	MinCP (NP)%
														P	
1048456415	ID	2016/02/17	@TF.D	30H	Intraday	Long/Short	STP	1474	81.30	-0.85	IDP-1A-DEC-2014_bsp-0	38_13_13	21	PASS	94.95
2002483117	ID	2016/02/17	@TF.D	30H	Intraday	Long/Short	STP	1014	94.06	-2.67	IDP-1A-DEC-2014_bsp-0	100_94_50	81	PASS	99.73
759306559	ID	2016/03/27	@E-ID.D	30H	Swing	Long	STP	1493	64.66	-0.21	IDP_dpmode-0_Bovychozh-2_SignalCono-1_trailSL-0	75_31_38	48	PASS	62.52
873980374	ID	2016/03/27	@E-ID.D	30H	Swing	Long	STP	1432	86.32	-0.94	IDP_dpmode-0_Bovychozh-2_SignalCono-1_trailSL-0	88_88_63	80	PASS	80.05
936257081	ID	2016/03/27	@E-ID.D	30H	Swing	Long	STP	1488	87.08	16.33	IDP_dpmode-0_Bovychozh-2_SignalCono-1_trailSL-0	38_38_13	30	PASS	64.14
1023365213	ID	2016/03/04	@TF.D	30H	Intraday	Long/Short	STP	541	66.01	116.04	IDP_dpmode-0_trailSL-0	38_31_25	31	PASS	99.96
2580963341	ID	2016/03/11	@TF.D	30H	Intraday	Long/Short	STP	685	84.25	12.47	IDP_dpmode-0_trailSL-0	75_44_33	51	PASS	88.82

Но это было только начало.

Создав стратегию и сохранив её в нашей базе данных, мы продолжаем ее отслеживать. Мы постоянно отслеживаем **все** стратегии в нашей базе данных, предоставляя **реальные** торговые данные вне выборки.

В то время, когда мы проводили наше исследование, у нас уже было около 18 месяцев **истинных** данных о производительности вне выборки, которых, по нашему мнению, было достаточно, чтобы получить надёжные результаты и сделать выводы.

Итак, мы просто взяли **реальные данные вне выборки** и разделили результаты на семь разных групп в соответствии с количеством **входных параметров для оптимизации**. У нас были стратегии, которые включали от одного до семи входных параметров оптимизации, и именно так мы пришли к группировке.

Далее нам нужно было решить, каковы будут наши критерии оценки.

У нас был долгий разговор об этом, и мы решили использовать свой собственный индекс, разработанный нашим хедж-фондом, под названием «avgDhidx».

AvgDhidx аналогичен Index1 на TradeStation, но является более сложным. Наш индекс измеряет качество на основе отношения чистой прибыли к просадке и качество кривой капитала (её стабильность и уровень корреляции с «идеальной» кривой капитала).

В целом, чем выше avgDhidx, тем лучше стратегия. При высоких значениях avgDhidx кривая капитала является более гладкой, менее неровной, а отношение чистой прибыли к максимальной просадке обычно является высоким.

Затем мы индивидуально рассчитали параметр avgDhidx истинной производительности вне выборки для каждой стратегии.

И, наконец, мы вычислили средние значения avgDhidx для каждой из семи групп.

Вот результат:

Входные параметры	avgDhidx
1	4.38
2	33.36
3	36.30
4	0.38
5	32.40
6	43.26
7	-2.97

Tlap.com

Входные параметры оптимизации

1. Функция пригодности, которая максимизирует чистую прибыль и количество прибыльных позиций и одновременно минимизирует внутридневную просадку. Она рассчитывается как чистая прибыль * кол-во прибыльных позиций / AbsValue (макс. внутридневная просадка)



Я никоим образом не говорю, что это исследование было идеальным. Совершенство даже не является нашим стандартом... Это то, что мы узнали от Джеффа Безоса, который сказал, что 80% оптимального достаточно, чтобы сделать оценку и вывод, и позволяет быстрее двигаться вперед. Если это работает для Amazon, то это также достаточно хорошо работает и для нас!

Этот подход дал нам ответы на вопросы, которые мы искали. Вот наиболее важные выводы, которые мы сделали из этого исследования:

1. Мы **не** увидели никаких доказательств того, что более простые стратегии являются лучшими. **Нет.** Это подтвердило мой предыдущий опыт, что **чрезмерное упрощение не** является решением.
2. Данное исследование показывает, что более шести входных параметров для оптимизации может быть потенциально опасным. Но когда речь идёт об истинной производительности вне выборки, между двумя или шестью входными параметрами нет **существенной разницы** в производительности.
3. Мы отметили низкое значение AvgDhidx при наличии четырёх входных параметров для оптимизации, и это нас немного удивило. Тем не менее, это была группа с наименьшим размером выборки, и я чувствую, что с бóльшим размером выборки она, вероятно, нормализовалась бы.

В заключение я могу сказать с очень высокой степенью уверенности, что когда дело доходит до пробойных торговых стратегий, построенных по моей формуле, вы определённо можете иметь стратегии с пятью или шестью входными параметрами для оптимизации, которые будут довольно надёжными и хорошо работать.

Итак, что именно я имею в виду под «входными параметрами для оптимизации»?

Вы уже знаете, что мы **всегда** хотим оптимизировать **фрактал** в рамках компонента **пространство**; таким образом, это уже является одним входным параметром для оптимизации.

Далее вы также можете оптимизировать свой стоп-лосс (ордер на закрытие сделки по акции или товару по указанной цене, чтобы ограничить убыток) или тейк-профит (о нём мы поговорим в следующей главе).

Итак, это уже три входных параметра, и можно использовать ещё три (помните, что шесть должно быть максимальным количеством входных параметров, используемых в моей формуле Мистера Пробой).

Таким образом, в ваших фильтрах доступны ещё три слота.

И неважно, какой фильтр вы используете. Опять же, это то, что в любом случае работает. Самое главное – держать количество входных параметров для оптимизации в пределах данного диапазона.

Например, вы можете использовать RSI и оптимизировать два его параметра: **период** RSI и **порог** RSI. Таким образом, в простой стратегии торговли на пробоях у вас уже будет пять входных параметров для оптимизации:

Входные параметры:

```
Fract(1),  
StopLoss(500),  
ProfitTarget(1000),  
RSI_Filter_Period(25),  
RSI_Threshold(20);
```

Тогда ваш фильтр может выглядеть так:

```
Filter_Long = RSI(RSI_Filter_Period) > (100 - RSI_Threshold);  
Filter_Short = RSI(RSI_Filter_Period) < (0 + RSI_Threshold);
```

Однако, поскольку у вас остался ещё один входной параметр, вы можете добавить ещё один фильтр, если хотите. Например:

Входные параметры:

```
Fract(1),  
StopLoss(500),  
ProfitTarget(1000),  
RSI_Filter_Period(25),  
RSI_Threshold(20),  
MA_Period(100);
```

А затем добавьте следующее условие:

```
Filter_Long_2 = Close > MovingAverage(MA_Period); Filter_Short_2 = Close <  
MovingAverage(MA_Period);
```

Опять же, креативность – это ключевой фактор.

Какой(ие) фильтр(ы) вы хотите протестировать, решать только вам. Пока вы придерживаетесь руководства о том, **сколько** входных параметров использовать, всё должно быть хорошо.

Итак, давайте сделаем небольшой перерыв и выполним короткое творческое упражнение. Просто уделите пять минут и подумайте по крайней мере о пяти идеях для фильтров, которые вы могли бы использовать. Это даст вам достаточный старт. Запишите их прямо сейчас:

Идея для моего фильтра №1: _____
Идея для моего фильтра №2: _____
Идея для моего фильтра №3: _____
Идея для моего фильтра №4: _____
Идея для моего фильтра №5: _____

В качестве некоторых финальных рекомендаций подчеркну: когда мы говорим о фильтрах в нашем хедж-фонде, мы думаем о **группах фильтров**. В частности, мы используем следующие **группы фильтров**:

1. Фильтры на основе Прайс Экшен
2. Фильтры на основе волатильности
3. Фильтры на основе силы тренда
4. Фильтры на основе объёма
5. Фильтры на основе скользящих средних
6. Экспериментальные (проприетарные) фильтры.

Когда мы работаем над новой стратегией торговли на пробное, мы начинаем с тестирования различных групп (внутри каждой группы у нас есть много разных фильтров). Как только мы увидим, какая группа лучше всего подходит для данного рынка и таймфрейма, мы начнём сокращать количество наших фильтров. Основываясь на количестве входных параметров для оптимизации, мы начинаем экспериментировать с комбинациями до двух фильтров, предпочтительно из разных групп фильтров (один из одной группы с наилучшим результатом и второй из следующей группы с наилучшим результатом).

Естественно, мы больше не делаем это вручную – для этого процесса команда в моём хедж-фонде создала сложную автоматизированную систему.

Но это не является темой этой книги. Данная книга посвящена **формуле**. Подумайте о рекомендации «**сколько**» как о «формуле в формуле».

Итак, теперь вы знаете мой ключевой секрет о **фильтрах**, и мы можем перейти к следующему компоненту, который является **временем**.

Параметр время

Прежде чем я расскажу о следующем важном компоненте формулы Мистера Пробои, я хотел бы ещё раз вернуться в прошлое и поделиться с вами короткой историей.

Вы уже знаете, что я дитя **революции** и что я очень хорошо знаю, что означает **притеснение**... и поэтому я ценю **свободу**, вероятно, больше, чем большинство людей, которые родились свободными и воспринимают свободу как должное.

И вы также знаете, что как только я получил свой первый вкус свободы, я посвятил себя тому, чтобы делать всё необходимое, чтобы жить свободно до самой смерти. Включая выход на российский чёрный рынок!

Так что вы, вероятно, не удивитесь, что через десять лет после революции в погоне за тем, чтобы выяснить, как добиться успеха в трейдинге и «обеспечить» мою свободу навсегда, я решил поехать в Соединенные Штаты.

Я имел честь использовать все свои торговые контакты, чтобы посетить там все крупнейшие торговые биржи. Я действительно хотел знать **всё** о трейдинге. И поскольку в то время электронная онлайн-торговля всё еще находилась в зачаточном состоянии, а большинство сделок совершалось на торговых площадках, я хотел понять, что делали там все эти сумасшедшие большие всегда громко кричащие парни.

Итак, я собрал чемодан, улетел в США, встретился со своими влиятельными друзьями из сферы трейдинга и посетил торговые биржи.

И мне понравился этот опыт.

Я имел честь посетить все основные фьючерсные биржи и биржи опционов в США, включая Чикагскую товарную биржу (CME), Чикагскую торговую палату (CBOT), Нью-Йоркскую товарную биржу (NYMEX) и Чикагскую биржу опционов (CBOE).

Благодаря моим контактам я также смог попасть прямо в биржевые ямы, в том числе в те районы, которые обычно являются недоступными для широких слоёв общественности.

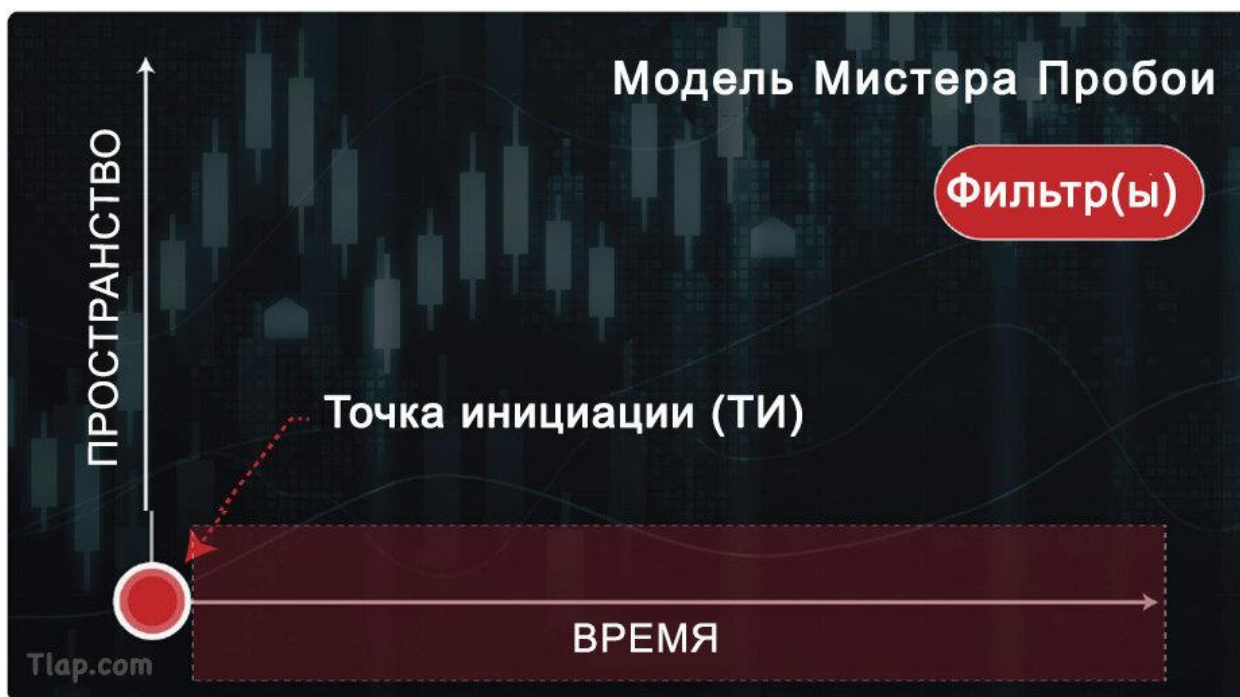
Это была отличная возможность пообщаться с трейдерами, а также с менеджерами хедж-фондов и представителями крупных банков, торговых фирм и фирм по хеджированию.

Мне подробно объяснили множество торговых процессов, а некоторые опытные трейдеры даже поделились со мной своими торговыми секретами во всех подробностях.

Но в конце концов, несмотря на безостановочное возбуждение, больше всего я хотел знать, есть ли нечто, что я мог бы изучить и внедрить в свою собственную торговлю.

Именно тогда я сделал своё следующее важное открытие. И это внезапное откровение было...

Время



Модель Мистера Пробои
Фильтр(ы)
Пространство
Время
Точка инициации (ТИ)

Имейте в виду, что в то время я всё ещё был дискреционным внутридневным трейдером. Алгоритмическая торговля была ещё чем-то новым, и в то время многих инструментов, широко доступных на сегодняшний день, ещё не было.

Таким образом, в рамках внутридневной торговли дискреционная торговля была стандартным подходом.

И каким-то образом я понял, что будучи удалённым внутридневным трейдером, я должен делать то же самое, что делали все эти большие парни в торговой яме: сидеть перед торговыми графиками на протяжении очередной торговой сессии, которая проходила с 15:30 до 22:15 по местному (пражскому) времени.

Однако во время моего визита в Чикагскую торговую палату (CBOТ) это предположение внезапно исчезло. Навсегда.

Была середина торгового дня, когда я осознал, что вся сумасшедшая громкая торговля в яме внезапно стала намного тише. Настолько тихой, что я почти подумал, что торговля полностью прекратилась.

И это сбило меня с толку.

Очень сильно сбило с толку.

Поэтому я обратился к своему гиду (опытному трейдеру биржевой ямы) и спросил его, что происходит.

«Обеденное время», – ответил он.

Это снова сбило меня с толку.

«Они не торгуют в обеденное время?» – спросил я.

С моим наивным убеждением, что в Америке деньги никогда не спят, а трейдеры – это супермашины, которые не едят и не спят, упустить крупную торговую возможность казалось для меня немыслимым.

Парень начал смеяться.

«Трейдеры – это просто люди», – ответил он и ушёл на свой собственный обеденный перерыв!

Это меня страшно **поразило**:

У меня не было никаких разумных причин сидеть перед моими торговыми графиками на протяжении всей торговой сессии!

Если «парни с большим опытом торговли в биржевой яме» не торговали на протяжении всей торговой сессии, то почему же тогда это должен делать я?

Зачем сидеть перед экраном во время обеда, когда **никто не** торгует?

Весь мой опыт, полученный во время посещения торговой ямы, в значительной степени подтвердил то, что я ранее уже наблюдал в своей собственной торговле. Наибольшая волатильность (крики и вопли), вероятно, происходили в начале и в конце торговой сессии.

Между ними был обед, за которым следовал скучный сонный послеобеденный период.

Итак, если наибольшая активность на многих рынках происходила в течение первых 1-2 часов после открытия рынка, то, скорее всего, я работал **слишком много**?

И если с 12:00 до 13:00 трейдеры были на обеде, то, вероятнее всего, я тратил слишком много своего времени впустую?

После этого удивительного «прозрения в яме» и моего возвращения домой из США я сразу же выполнил очень простую оценку:

1. Я взял таблицу Excel всех моих сделок, совершённых на реальном рынке (я очень хорошо отслеживал их, вплоть до мельчайших деталей);
2. Разделил все свои сделки по часам (сделки, совершенные в первый час торговой сессии, во второй час торговой сессии и т. д.);
3. Глядя на это распределение, я не мог поверить в то, что увидел: 80% моей прибыли было получено в течение первых двух часов торговли!

Как я мог упустить это из виду? Я был очень сильно раздражён собственным невежеством!

Так много работы после первых двух часов торговой сессии – дополнительные 4,5 часа перед торговым экраном – за такие **маленькие** деньги!

Я немедленно прекратил всю свою торговлю после первых двух часов (позже я расширил её до первых 2,5 часов торговой сессии, которую определил как «золотую середину»).

С тех пор, как я обедал на этаже CBOT, я **знал**, что **время дня имеет значение** в торговле.

Большое значение.

Это было одним из моих самых поразительных открытий и осознанием самой важной правды о трейдинге.

Поэтому неудивительно, что когда я перешёл на алгоритмический автоматизированный трейдинг, это было одним из самых важных понятий, которые я привнёс со времён своей дискреционной торговли. Именно поэтому я **должен был** включить параметр время в свою формулу торговли на пробоях, и именно поэтому он абсолютно необходим и для вас.

Итак, как вы применяете его на практике?

Его суть очень проста:

1. Если вы уже торгуете на определённом рынке и очень хорошо знаете его, выполните оценку, аналогичную той, какую проделал я. В качестве альтернативы вы можете использовать индикатор **объём** и индикатор ATR (Average True Range), чтобы выяснить, в какое время суток рынок является наиболее волатильным, и найти лучшие возможности в течение дня.

Затем начните создавать стратегии торговли на пробоях со входами в рынок, ограниченными этим временным периодом дня. Даже если другие часы тоже могут быть прибыльными, помните, что ограничение вашей торговли «лучшей» частью торговой сессии может значительно увеличить вашу среднюю производительность, уменьшить количество ложных пробоев и улучшить соотношение чистой прибыли к просадке. Именно **такими** и должны быть ваши цели.

2. Если вы новичок в трейдинге, разделите дневную торговую сессию на два-четыре равных сегмента и для каждого сегмента создайте несколько стратегий торговли на пробоях.

Проделайте то же самое в течение всей сессии, а затем сравните результаты.

Есть ли какая-то часть дня, которая, как вам кажется, даёт вам лучшие сделки, более высокую среднюю торговлю или лучшее соотношение чистой прибыли к просадке? Если да, торгуйте только в этом сегменте и продолжайте оценивать свои результаты. В будущем такой подход окупится!

И это действительно всё, что есть в последнем компоненте модели Мистера Пробои – **время**.

Позвольте мне завершить этот раздел простым примером.

Этот пример не только даст вам полное представление о параметре **время** в формуле Мистера Пробои, но и предоставит код со **всеми параметрами**, вместе взятыми (чтобы вы могли получить представление о том, как выглядит готовая стратегия).

Для этого примера я создал суперпростую стратегию торговли на пробоях. Я не проводил никаких стресс-тестов или тестов на надёжность... Её единственная цель состоит в том, чтобы показать вам код для завершённой стратегии торговли на пробоях, а не дать готовый для торговли код. Чтобы развернуть её в режиме реального времени, потребуется провести большее количество тестирований.

Данный код выглядит следующим образом (и он довольно близок к тому, как выглядит подавляющее большинство моих стратегий торговли на пробоях):

`{BREAKOUT_TRADING_REVOLUTION_CODE_1`

Данный код представлен исключительно в качестве примера! Он **не** является настоящей торговой стратегией!

Данный код предназначен исключительно для образовательных целей.

Отказ от ответственности. Торговые системы для фьючерсных рынков и торговля сырьевыми товарами несут высокую степень риска.

Люди могут терять деньги и действительно теряют их. Гипотетические результаты содержат множество неотъемлемых ограничений.

Прошлая производительность не гарантирует будущих результатов. 2022(c)BetterTraderAcademy.com / 2022(c)Томас Неснидал

Рынок: E-mini Dow Jones.

Символ: YM.D.

Шаблон времени: обычные часы торговой сессии.

Таймфрейм: 20-минутный}

```
Input:
Fract(2.8),
Filter_Period(45);
vars:
POI(0), SPACE(0), myBreakoutLong(0), FILTER(false);
//Point Of Initiation POI = CloseD(1);
//For the calculation of the space SPACE = fract * AvgTrueRange(40);
//The BreakoutLevel (POI + space) myBreakoutLong = POI + SPACE;
//Filter
FILTER = ADX(25) < Filter_Period;
//Entry Condition
If marketposition = 0 and FILTER then buy next bar myBreakoutLong stop;
//Exit at the end of the day if marketposition <> 0 then setexitonclose;
//Set stop-loss 1500 USD Setstoploss(1500);
```

В этой простой модели в качестве **точки инициации** мы взяли цену закрытия вчерашнего дня. Затем для расчета **пространства** мы добавили к ней 2,8 x ATR(40). **Фрактал** (2,8) был оптимизирован. Мы добавили **пространство** к ТИ и рассчитали окончательную цену для **длинной позиции** на пробое (**myBreakoutLong**).

Для простоты я разработал этот пример как стратегию для открытия только длинных сделок, но если вам нужно добавить ещё и короткие сделки, вам просто нужно будет вычесть **пространство** из ТИ, и это условие будет выглядеть следующим образом:

```
myBreakoutShort = POI - SPACE;
```

Затем мы добавили простой фильтр ADX. Я оптимизировал порог фильтра (45).

И, наконец, я добавил выход в конце дня и защитный ордер стоп-лосс в размере 1500 USD (о выходах мы поговорим в следующей главе).

Вот и всё.

Это результат работы данной стратегии на фьючерсном контракте E-mini Dow Jones (YM) на 20-минутном таймфрейме.

(Но, опять же, это всего лишь пример моделирования, никакого стресс-тестирования или любого вида тестирования на устойчивость не проводилось):



Кривая капитала
Капитал
Количество сделок

Теперь я немного модифицирую этот код, отдельно тестируя разные временные интервалы, чтобы увидеть влияние элемента **времени**:

`{BREAKOUT_TRADING_REVOLUTION_CODE_2`

*Данный код представлен исключительно в качестве примера! Он **не** является настоящей торговой стратегией!*

Данный код предназначен исключительно для образовательных целей.

Отказ от ответственности. Торговые системы для фьючерсных рынков и торговля сырьевыми товарами несут высокую степень риска.

Люди могут терять деньги и действительно теряют их. Гипотетические результаты содержат множество неотъемлемых ограничений.

Прошлая производительность не гарантирует будущих результатов. 2022(c)BetterTraderAcademy.com / 2022(c)Томас Неснидал

Рынок: E-mini Dow Jones.

Символ: YM.D.

Шаблон времени: обычные часы торговой сессии.

Таймфрейм: 20-минутный}

```
Input:
Fract(2.8),
Filter_Period(45),
Test_Hour(0); //0-6
vars:
POI(0), SPACE(0), myBreakoutLong(0), FILTER(false), TimeFilter(false);
//Point Of Initiation POI = CloseD(1);
//For the calculation of the space SPACE = fract * AvgTrueRange(40);
//The BreakoutLevel (POI + space) myBreakoutLong = POI + SPACE;
//Filter
FILTER = ADX(25) < Filter_Period;
If Test Hour = 0 then TimeFilter = (time > 830 and time <= 930);
If Test Hour = 1 then TimeFilter = (time > 930 and time <= 1030);
If Test Hour = 2 then TimeFilter = (time > 1030 and time <= 1130);
If Test Hour = 3 then TimeFilter = (time > 1130 and time <= 1230);
If Test Hour = 4 then TimeFilter = (time > 1230 and time <= 1330);
If Test Hour = 5 then TimeFilter = (time > 1330 and time <= 1430);
If Test_Hour = 6 then TimeFilter = (time > 1430 and time <= 1515);
//Entry Condition
If marketposition = 0 and FILTER and TimeFilter then buy next bar myBreakoutLong stop;
//Exit at the end of the day if marketposition <> 0 then setexitonclose;
//Set stop-loss 1500 USD Setstoploss(1500);
```

С помощью этой модификации теперь я могу тестировать разные временные интервалы, начиная с временного интервала 08:30-09:30 (Test_Hour = 0) и заканчивая временным интервалом 14:30-15:15 (If Test_Hour = 6). Причина, по которой последний временной интервал короче остальных (всего 45 минут в сравнении с 60 минутами), заключается в том, что рынок закрывается в 15:15.

Далее я запускаю быструю оптимизацию и получаю такой результат:

	MODEL-TM Test_Hour	Test	All: Net Profit	All: Total Trades	All: Avg Trade	All: Max Intraday Drawdown	All: ProfitFactor	All: TS Index
1	6	6	50,770.00	845	60.08	-10,725.00	1.59	2,149.14
2	5	5	8,070.00	767	10.52	-10,590.00	1.10	278.91
3	4	4	2,290.00	715	3.20	-15,360.00	1.02	56.06
4	3	3	-2,610.00	690	-3.78	-20,005.00	0.97	-47.36
5	2	2	4,870.00	660	7.38	-18,560.00	1.05	92.89
6	1	1	10,865.00	677	16.05	-15,815.00	1.09	248.70

Что это нам говорит? Ну, довольно много важных вещей:

1. Если мы ограничим стратегию последними 45 минутами торговой сессии (Test_Hour = 6), мы заработаем больше денег, чем с помощью оригинальной стратегии.

Нередко можно увидеть, что стратегия с ограничением по времени приносит больше денег, чем без каких-либо ограничений по времени.

(И просто чтобы объяснить, почему итог всех шести ограничений по времени не равен чистой прибыли оригинального примера **без каких-либо ограничений по времени**. Это потому, что сделки с ограничениями по времени осуществляются немного по-другому. Мы можем открыть

позицию **только** в том случае, если у нас еще нет ни одной открытой позиции. Это означает, что некоторые из ограниченных по времени сделок **не** будут открыты, поскольку уже открыта другая сделка. Возможно, на данный момент это звучит слишком запутанно. Но не волнуйтесь. С небольшой практикой и собственным тестированием вы скоро поймёте, как это работает. И, что тоже является важным, просто начните использовать и тестировать эту формулу на практике, не слишком задумываясь о ней.)

2. Данный тест подтверждает мою точку зрения о низкой волатильности и активности во время обеденного перерыва: торговля в интервале времени между 11:30 и 12:30 приводит только к убыткам: \$2 610, если быть точным. (Test_Hour = 3)

3. Кривая капитала с ограничением по времени выглядит довольно неплохо:



Кривая капитала
Капитал
Количество сделок
Сделки
Пики

В этом и есть сила параметра **время**. Оно часто будет давать вам лучшие результаты (но не всегда).

Теперь, когда вы знаете все компоненты, давайте перейдём к заключительной части формулы Мистера Пробои: **выходы**

Выходы из рынка

Мы должны где-то выходить из наших сделок. Итак, как вы определяете лучшие цели для выхода из своих пробойных сделок?

Формула Мистера Пробои дает **всё**, что вам необходимо для создания удивительных прибыльных пробойных торговых стратегий... но они не могут быть завершены без выходов!

Итак, как вы определяете свои выходы? И какие выходы вы должны использовать?

Правда в том, что выходы из рынка могут быть такими же сложными или даже более сложными, чем входы в рынок. Тем не менее, наше обширное исследование хедж-фондов снова и снова доказывало нечто действительно замечательное:

В моей модели Мистера Пробои самое простое решение почти всегда работает лучше всего.

Первоначально, когда мы создавали хедж-фонд на основе пробойных стратегий, мы кодировали множество различных методов выхода:

- на основе фиксированной суммы в USD,
- на основе волатильности,
- на основе определённого значения в %,
- на основе времени и
- некоторые очень продвинутые и проприетарные методы.

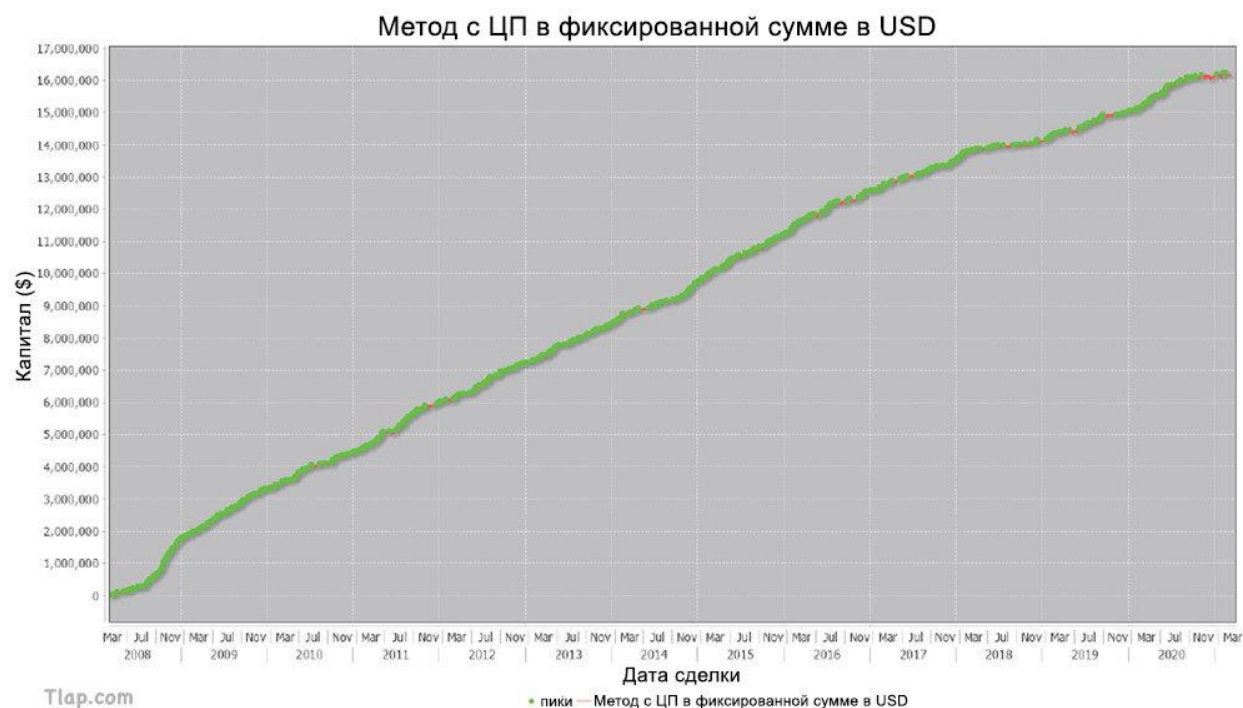
Затем мы провели большую оценку сотен стратегий (так же, как мы это сделали с оптимизацией входов в рынок).

Но, к моему (не такому большому) удивлению, **лучшей** по производительности из **всех** этих стратегий (неоднократно протестированных на **всех** фьючерсных рынках и на протяжении многолетних данных) неизменно является стратегия с **целью по прибыли, основанной на фиксированной сумме в долларах**.

Именно этот выход я использовал в течение многих лет в своей частной торговле на пробоях. И даже до этого я использовал его в течение многих лет в своей дискреционной торговле.

К сожалению, я не могу поделиться с вами графиком с полным сравнением, поскольку команда в моём хедж-фонде не хочет, чтобы я раскрывал суть наших проприетарных методов.

Но чтобы вы имели представление, вот наши стратегии с **целью по прибыли, основанной на фиксированной сумме в долларах**, которые мы использовали в качестве **единственной** техники выхода, отличной от ордера стоп-лосс (который мы применяли в предыдущих примерах), и они работают волшебным образом:



Метод с ЦП в фиксированной сумме в USD

Капитал (\$)

Дата сделки

Пики

И это не первый раз, когда мы видим такое.

В прошлом мы уже несколько раз проводили аналогичные анализы «видов цели по прибыли», и, как я уже сказал, мы продолжаем наблюдать одно и то же снова и снова:

Цель по прибыли, основанная на фиксированной сумме в долларах, является самой простой, но самой мощной в использовании!

По крайней мере, для пробойных стратегий, основанных на моей формуле Мистера Пробои.

Кроме того, для внутридневных торговых стратегий мы также используем выходы в **конце дня**, а для стратегий торговли на колебаниях – выходы в **конце недели**.

Итак, многие из наших стратегий торговли на пробоях используют эту **комбинацию**:

1. Стоп-лосс на основе фиксированной суммы в USD,
2. Цель по прибыли на основе фиксированной суммы в USD,
3. Выходы в конце дня или недели.

Время от времени мы добавляем к этой комбинации время выхода, и в нашем хедж-фонде мы провели тщательное исследование по этому вопросу.

В этом втором исследовании, используя тысячи торговых стратегий многолетних истинных данных вне выборки, взятых из базы данных нашего хедж-фонда, мы сгруппировали все стратегии в различные виды выходов:

1. Цели по прибыли (ЦП)

Они включали в себя все виды целей по прибыли, от основанных на фиксированной сумме в USD до основанных на волатильности и определённом значении в %, а также некоторые проприетарные цели по прибыли. Но у всех них была одна общая черта: целевой ордер тейк-профит, размещённый при входе в рынок.

2. Простые условия без ЦП

Они подразумевают выходы в конце дня, недели или временные выходы.

3. Комбинация вышеперечисленных

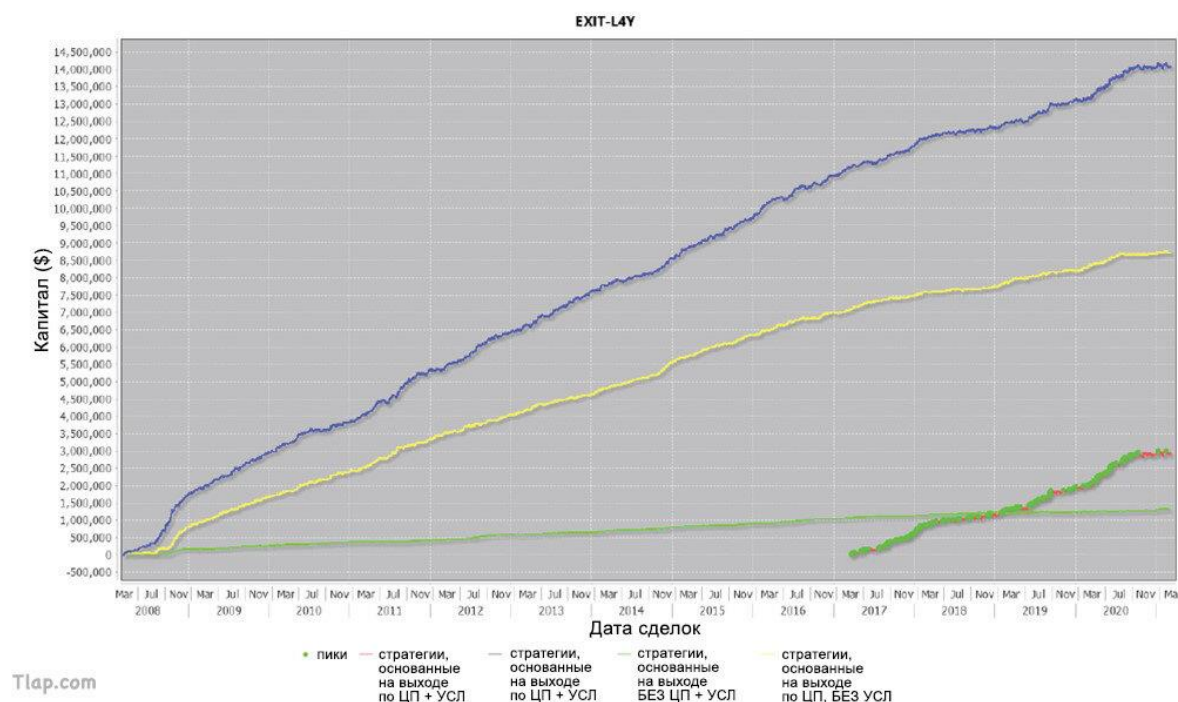
(Я также должен упомянуть одну важную вещь – она применима только к стратегиям свинг-трейдинга, поскольку 90% стратегий в нашем хедж-фонде являются стратегиями свинг-трейдинга. Во внутридневных торговых стратегиях мы используем выходы только в конце дня.)

Лично я никогда не был поклонником комбинации ЦП + другое условие выхода. Для меня это всегда казалось ненужным усложнением торговой стратегии, которое делает её более склонной к чрезмерной аппроксимации.

Я всегда считал, что для лучшей диверсификации «правильным» является использование обоих подходов по отдельности (некоторых стратегий с использованием ЦП и других условий для выходов). Да, это **помогает** с корреляциями и сглаживанием капитала, но я никогда не верил в их комбинацию.

Именно поэтому я был глубоко **шокирован** тем, что увидел, когда мы сгруппировали наши стратегии, как описано выше, а затем совместили кривые капитала на один график.

Не обращайте, пожалуйста, внимания на цифры на оси Y, поскольку они не имеют значения; эти группы были нормализованы, чтобы можно было сравнивать «яблоки с яблоками», и каждая группа также имела одинаковый размер выборки. Данный график представлен не с целью демонстрации **абсолютной** производительности каждой группы, а с целью сравнения их относительных показателей:



Exit-L4Y
Капитал (\$)

Дата сделок

Пики

Стратегии, основанные на выходе по ЦП + УСЛ.

Стратегии, основанные на выходе по ЦП + УСЛ.

Стратегии, основанные на выходе БЕЗ ЦП + УСЛ.

Стратегии, основанные на выходе по ЦП, БЕЗ УСЛ.

Если вы внимательно посмотрите, то заметите следующее:

Стратегии, основанные на альтернативных условиях выхода без применения какой-либо ЦП (зеленая кривая капитала), показали худшую производительность.

Стратегии, в которых применялась только ЦП (желтая кривая капитала), показали значительно лучшую производительность.

А вот стратегии, которые использовали **комбинацию** ЦП + условия (синяя кривая капитала), полностью **превзошли** все предыдущие версии и показали самую лучшую производительность!

Я не ожидал.

Однако...

Прохождение этого упражнения выявило совершенно новое направление для нашего хедж-фонда и показало нам, как **именно** начать извлекать **больше** денег с рынков!

Итак, вот правила для выхода из рынка в формуле Мистера Пробои:

1. Используйте ордера стоп-лосс и тейк-профит, основанные на фиксированном значении в USD.
2. **Оптимизируйте их.**
3. Не забывайте, что эти параметры для выхода будут включены в правило «максимум 6 входных данных для оптимизации».
4. В качестве альтернативы комбинируйте их с выходами в конце дня, недели или с выходами с привязкой ко времени.

Вот и всё.

Именно так вы получаете свою окончательную лицензию на печатание денег!

Подведём итоги

Теперь вы знаете **всё** о моей секретной формуле торговли на пробоях.

И если вы даже немного амбициозны и действительно хотите добиться успеха, вы уже определили свою собственную ТИ и идеи касательно **фильтров**.

Теперь настало время подумать о том, как вы соберёте все эти компоненты воедино, чтобы начать создавать свои первые стратегии торговли на пробоях.

На данном этапе часто возникает вопрос: каковы следующие шаги по практическому применению этой формулы?

Хорошей новостью является то, что вы должны сделать всего лишь две вещи:

1. Создайте свой собственный список идей для ТИ и **фильтров** (поскольку у вас уже есть **все** ответы касательно **пространства, времени и выходов**) и
2. Экспериментируйте, экспериментируйте, экспериментируйте!

Это и весь волшебный ключ... Пробуйте множество различных комбинаций, пока не найдёте подходящую для вас, сохраняя при этом количество параметров оптимизации от 3 до 6, чтобы избежать чрезмерной аппроксимации и подгонки.

Но я понимаю, что для некоторых этого может быть недостаточно. Итак, в этой главе я собираюсь поговорить ещё о трёх вещах, о которых спрашивают многие трейдеры: программное обеспечение, история данных и размер выборки.

1. Программное обеспечение

Многие начинающие трейдеры слишком озабочены менее важными проблемами.

Хотя вам нужно какое-то программное обеспечение для создания, тестирования, оптимизации и торговли на ваших пробойных стратегиях, вы должны понимать, что программное обеспечение – это всего лишь инструмент. Не существует «идеального» решения, и каждый трейдер может предпочесть иное приложение.

К счастью, модель Мистера Пробойки является универсальной и может применяться к **любому** программному обеспечению. Я даже знаю трейдеров, которые полностью кодируют её на языке Python.

По этой причине я не могу поделиться ни одним программным обеспечением, кроме как предлагаемой платформой TradeStation. Это единственное программное обеспечение, которое я когда-либо использовал. Оно соответствует всем критериям, которые мне нужны: оно является бесплатным (как только вы откроете на нём аккаунт); оно предоставляет всю необходимую мне историю данных; язык кодирования EasyLanguage является простым, лёгким и очень хорошо документируется на веб-страницах платформы TradeStation.

Я разработал **все** свои стратегии торговли на пробоях, а также 2041 стратегию в нашем хедж-фонде именно на платформе TradeStation, которую мы также используем для исполнения своих сделок.

Я просто не слишком интересуюсь каким-либо другим программным обеспечением. Тем не менее, я знаю, что есть трейдеры, которые закодировали мою формулу в NinjaTrader, MetaTrader и других популярных торговых платформах. Я не знаю, как именно, и, как я уже сказал, мне не нужно этого знать. Для меня TradeStation является отраслевым стандартом и лучшим выбором.

2. История данных

Вопрос истории данных является **гораздо** более важным, чем само программное обеспечение.

В общем, вам нужно как минимум 10 лет истории данных хорошего качества. Это то, на чем я строю свои стратегии, а также история, которую мы используем в нашем хедж-фонде.

При разработке вашей стратегии вам нужно не менее 10 лет истории данных, чтобы охватить диапазон волатильности, трендов и экономических условий. Глубокий исторический анализ ваших стратегий гарантирует, что они будут **надёжными**.

Чтобы максимально увеличить шансы на то, что ваши пробойные торговые стратегии будут работать в будущем, вы должны убедиться, что они отлично работают в различных рыночных условиях.

Таким образом, правило «10 лет» является ещё одним золотым правилом.

Кроме того, вам также нужны данные **хорошего качества**, включая данные **X-минутных** таймфреймов. Формула Мистера Пробои лучше всего работает при тестировании на 30-минутных, 60-минутных, 90-минутных, 120-минутных или аналогичных таймфреймах. С внутридневными данными дела обстоят гораздо сложнее. X-минутные таймфреймы являются самыми надёжными.

Поэтому вы должны убедиться, что все эти требования соблюдены вашим поставщиком данных.

Опять же, с платформой TradeStation мне не нужно беспокоиться об этом. В неё включена вся высококачественная история данных с разрешением до 1 минуты. TradeStation также предоставляет непрерывные контракты для всех фьючерсных рынков, поэтому всё, что мне нужно в отношении истории данных, доступно одним щелчком мыши, что экономит мне массу времени.

3. Размер выборки

И, наконец, в мире алгоритмической торговли также имеет значение **размер выборки**.

Таким образом, все ваши стратегии должны соответствовать критериям минимального размера выборки, чтобы считаться статистически обоснованными.

Что же это за критерии?

В целом по меньшей мере несколько десятков сделок в год. Для бэктестирования на 10-летней истории вам понадобится как минимум несколько сотен сделок.

В нашем хедж-фонде размер выборки за 10-летнюю историю составляет от нескольких сотен до 2000 сделок.

Теперь вы действительно знаете **всё**, что нужно, чтобы полностью реализовать мою формулу Мистера Пробои.

Единственное, что мы ещё не рассмотрели – это процедуры тестирования на надёжность, но это уже совсем другая, отдельная тема. В этой книге я обещал вам формулу, и я исполнил своё обещание вплоть до мельчайших подробностей.

Тем не менее, чтобы дать вам хотя бы некоторые рекомендации в этой области, предлагаю вашему вниманию три основных пункта **надёжности**, которые следует иметь в виду при построении стратегий:

1. Используйте самую строгую процедуру проверки надёжности, которую вы только сможете придумать. Возможно, вам придётся изучить некоторые из них в Интернете, но общий совет состоит в том, чтобы объединить их вместе и установить планку как можно выше.
2. Если вы уже создали и используете какие-то процедуры тестирования на надёжность независимо от того, какими они являются, подумайте, как сделать их ещё более жёсткими.
3. Если вы всё ещё не знаете, с чего начать, хорошей отправной точкой может стать простая проверка на нескольких рынках.

И это всё.

Теперь позвольте мне поделиться с вами некоторыми **невероятными** успехами, которых я – и другие – уже достигли с помощью формулы Мистера Пробои. Ваша история успеха может быть следующей!

Часть III

Успех

Моя 2041 стратегия торговли на пробоях

Теперь пришло время поделиться с вами вдохновением, наконец-то зажечь искры в вас и показать, что с волшебной формулой Мистера Пробои **всё** возможно.

(И на самом деле в жизни **всё** возможно, как я узнал из моего удивительного опыта бархатной революции).

Я хочу показать вам, что моя формула Мистера Пробои действительно является революционным способом создания жизнеспособных стратегий торговли на пробоях. И эта формула, наконец, устраняет те бесконечно утомительные часы, дни, недели и даже месяцы, которые трейдеры потратили в прошлом, чтобы создать хотя бы **одну** жизнеспособную торговую стратегию.

Эти дни прошли.

Ваше стремление к жизнеспособному торговому подходу вошло в будущее, и вам больше не нужно думать с точки зрения «удачи в создании нескольких новых стратегий каждый год». Теперь у нас есть роскошь мыслить с точки зрения сотен, даже **тысяч** торговых стратегий на стольких рынках и таймфреймах, на скольких вы хотите.

И это не преувеличение. Чтобы продемонстрировать вам то, что возможно получить с помощью формулы Мистера Пробои, давайте начнём со стратегий, которые мы разработали в моем хедж-фонде. (Название этого раздела – «Моя 2041 стратегия торговли на пробоях», но на самом деле они являются стратегиями нашего хедж-фонда.)

На сегодняшний день мы разработали 2041 высококачественную стратегию торговли на пробоях на девяти совершенно разных категориях рынка и на 34 различных рынках.

First < 1 of 82 > Last

Tlap.com

Select Filter

All candidates: no filter

Records: 2041

2 041 высококачественная стратегия торговли на пробоях

Candidate

CID	Tags	Created	Symbol	TF	Style	LSB	Order Type	No.Trades	IECP %	DHIDX
C7800-[@YM][TF80M] ID		2020/08/26	@YM	80M	Swing	Short	STP	362	-82.06	-7.10
C5920-[@NG][TF30M] ID		2020/06/14	@NG	30M	Swing	Long/Short	STP	732	65.32	390.92
C15613-[@NG][TF30M] ID		2020/06/15	@NG	30M	Swing	Long/Short	STP	362	75.38	0.00
C5772-[@FESX][TF80M] ID		2020/10/21	@FESX	80M	Swing	Long/Short	STP	440	53.72	-190.68
C15890-[@CL][TF88M] ID		2020/04/17	@CL	88M	Swing	Long/Short	STP	717	74.09	308.42
C16445-[@NG][TF30M] ID		2020/06/15	@NG	30M	Swing	Long/Short	STP	504	62.81	-60.73

Из них мы рассмотрели 1706 стратегий, с помощью которых можно торговать в нашем хедж-фонде. Некоторые рынки, такие как рынки свиного бекона, пиломатериалов или апельсинового сока, были признаны непригодными к данной формуле из-за очень низких объёмов, что неприемлемо для размера нашего хедж-фонда.

Как я уже говорил, наш единственный фокус – это **фьючерсные** рынки. Эти рынки приносят нам наибольшую прибыль, позволяя нам достигать наилучших возможных корреляций в нашем портфеле (и, следовательно, создавать действительно **глобальный** бизнес). С фьючерсами мы участвуем в строго регулируемой, централизованной, хорошо защищённой и установленной торговой среде (не так, как на криптовалютном или валютном рынках).

Таким образом, наш метод всегда заключался в том, чтобы иметь **десятки** отличных надёжных жизнеспособных пробойных торговых стратегий в каждой категории фьючерсного рынка. Структура наших пробойных торговых стратегий следующая:

Категория фьючерсов	Кол-во стратегий
Индексы	530
Энергоносители	259
Зерно	191
Металлы	200
Мягкие товары	137
Валюты	108
Мясо	15
Облигации	50
Европейские рынки	216
Итого:	1706

Вот более детальная разбивка, показывающая, сколько стратегий мы разработали для каждого рынка в частности:

Категория	Рынок	Символ	Стратегии
Индексы	E-mini Dow Jones	YM	238
	E-mini SP 500	ES	238
	E-mini NASDAQ	NQ	54
Энергоносители	Природный газ	NG	102
	Сырая нефть	CL	51
	Реформулированный компонент бензина	RB	70
	Топочный мазут	HO	36
Зерно	Соя	S	106
	Пшеница	W	50
	Кукуруза	C	5
	Соевое масло	BO	30
Металлы	Золото	GC	119
	Серебро	SI	15
	Высококачественная медь	HG	17
	Платина	PL	49
Мягкие товары	Сахар	SB	54
	Кофе	KC	20
	Вата	CT	63
Валюты	Японская йена	JY	42
	Евро	EC	13
	Британский фунт	BP	31
	Швейцарский франк	SF	22
Мясо	Свинина	LH	15
Облигации	30-летние казначейские облигации США	US	18
	10-летние казначейские облигации США	TY	32
Европейские рынки	Немецкий DAX	FDAX	77
	Euro Stoxx 50	FESX	36
	Euro-Bunds	FGBL	102

Вы, наверное, задаётесь вопросом, **зачем так много стратегий?**

На то есть три причины:

1. Просто потому, что мы можем.

Данная формула является настолько мощной и универсальной, что нет причин, по которым мы не смогли бы создать буквально десятки тысяч стратегий. Нет ограничений. Конечно, в будущем мы планируем разработать ещё большее их количество, потому что мы можем это делать. Но на сегодняшний день это всё, что нам было нужно для создания и запуска наших первых портфелей.

2. Потому что мы любим роскошь иметь «лучшие из лучших» стратегий, доступных для создания больших портфелей.

За эти годы мы узнали, что создание портфеля является ключевым фактором стабильности. Мы уже говорили об этом в разделе «3 правила успеха в торговле на пробоях», но просто напомним: чем ниже средняя корреляция между стратегиями в портфеле, тем лучше. Чем стабильнее распределение прибыли, тем безопаснее ваш бизнес.

Мы всегда стремимся к «идеальному» портфелю (стабильная и плавная кривая капитала, которая неуклонно растёт), и наличие множества стратегий на выбор значительно облегчает эту задачу. На самом деле, по нашим оценкам, чтобы создать «идеальный» портфель из 10-15 стратегий торговли на пробоях, нам может потребоваться до 100 стратегий на выбор. Именно поэтому мы создали такую большую базу стратегий.

3. Потому что мы мыслим масштабно.

Мы любим ставить перед собой **большие** цели. И с помощью наших портфелей мы постоянно выходим за пределы допустимого. На сегодняшний момент самый крупный портфель торговли на пробоях в нашем хедж-фонде состоит из ошеломляющих 120 стратегий. Потому что мы любим мыслить масштабно.

Потому что мы **можем**. У нас есть формула, и с этой формулой нет ограничений.

В дополнение к этим фьючерсным портфелям мы также создали множество стратегий торговли на пробоях на **фондовом** рынке и торгуемых индексных фондах (ETF). Однако, к сожалению, лицензия нашего хедж-фонда не позволяет нам торговать на фондовом рынке (пока).

Честно говоря, я даже не знаю, заинтересован ли я вообще в торговле на фондовом рынке. Корреляции между многими акциями довольно высоки, и я до сих пор не нашёл ни одного преимущества фондового рынка перед фьючерсными рынками. Я на 100% убеждён, что фьючерсы – это лучшая, самая безопасная и самая захватывающая долгосрочная ставка.

Кроме того, большинство фьючерсных рынков теперь предлагают **микроконтракты**, а это означает, что торговать фьючерсами довольно легко могут даже трейдеры с небольшими торговыми счетами. Формула Мистера Пробои, конечно же, работает как на **микроконтрактах**, так и на любом другом фьючерсном рынке.

Дело в том, что с формулой Мистера Пробои вы не ограничены в торговых возможностях.

Зачем думать о мелочах, если у нас есть все инструменты, чтобы мыслить **масштабно**?

Помните, **что всё** возможно, несмотря ни на какие трудности. Я знаю это каждой клеточкой моего тела... Я жил при самом репрессивном режиме, который только можно себе представить, но сегодня я свободнее самой свободы.

Так что никаких **но**, никаких оправданий. Просто раздвиньте границы, расширьте свою реальность.

Потому что вы **можете**...

Никогда не знаешь, как далеко заведёт тебя это путешествие. Я бы не поверил, что в один прекрасный день буду управлять своим собственным хедж-фондом, особенно для институциональных клиентов (то есть нашими клиентами являются только крупные банки и пенсионные фонды, а не розничные инвесторы). И всё же я здесь. Я никогда не собирался становиться финансовым менеджером, но успех формулы Мистера Пробои принёс мне больше роста, чем я мог себе представить.

Теперь позвольте мне привести несколько примеров наших собственных стратегий торговли на пробоях. Конечно, я мог бы поделиться с вами сотнями из них, но у нас нет для этого ни места, ни времени. Но, по крайней мере, я могу поделиться одной стратегией из каждой категории фьючерсного рынка.

И прежде чем я покажу эти примеры, дам вам несколько важных замечаний:

1. В каждом примере вы увидите вертикальную линию на графике кривой капитала. Всё, что находится справа от линии, является **реальными** результатами **вне выборки**: это означает, что данные, показанные справа от этой вертикальной линии, представляют собой сделки, реализованные на новых, свежих данных, которые не существовали при разработке стратегии. Это даст вам хорошее представление о стабильности стратегии и покажет, насколько хорошо отработывала себя данная стратегия после того, как была протестирована.
2. Все примеры построены на 10-летней истории данных. Таким образом, результаты, которые вы увидите, представляют собой комбинацию бэктестирования на 10-летней истории + 0,5-2 года истинной истории вне выборки (в зависимости от того, как долго стратегия была в нашей базе данных).
3. Все примеры представлены **после** вычета издержек на исполнение сделок (брокерской комиссии, небольшого проскальзывания на входе и небольшого проскальзывания на выходе). Проскальзывание составляет 1-2 тика на входе и 1-2 тика на выходе, в зависимости от рынка.
4. Все примеры были построены **точно** в соответствии с формулой Мистера Пробои: это означает, что все стратегии состоят из точки инициации, пространства, фильтра, временных условий и некоторых видов выхода или комбинации выходов. Все эти стратегии также прошли тщательное стресс-тестирование и показали удовлетворительные результаты на большинстве других рынков в рамках той же категории фьючерсов.
5. Все результаты представлены на одну торговую **единицу**, которая в торговле фьючерсами является **одним контрактом**. Например, когда вы видите прибыль в размере \$120 000, это прибыль за 10 лет (+ 0,5-2 года реальной торговли вне выборки) и за 1 контракт. Что в среднем составит около \$11 000 в год по одному контракту. Если бы вы торговали двумя контрактами, то прибыль составила бы \$22 000 и т. д. Вы можете торговать столькими контрактами, сколькими захотите. (В будущем всегда думайте с точки зрения контрактов. На фондовом рынке всегда думайте с точки зрения акций, а на валютном – с точки зрения лотов. Все они относятся к торговым **единицам**.)

Хорошо, теперь у вас есть объяснение того, на что мы смотрим, поэтому давайте перейдём к примерам.

1. Индексы

Это моя любимая категория фьючерсов. Жизнеспособные высококачественные стратегии торговли на пробоях на индексах создаются быстро и просто. У меня большой опыт работы с индексами в рамках моей дискреционной торговли, и это была также первая категория, с которой я начал свою алгоритмическую торговлю. Большинство стратегий торговли на индексах лучше работают на длинной стороне из-за общего бычьего тренда в индексах. Прилагаю пример стратегии торговли на E-mini Dow Jones (YM) на 70-минутном таймфрейме:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 53 250,00	\$ 51 145,00	\$ 2 105,00
Валовая прибыль	\$ 192 230,00	\$ 173 590,00	\$ 18 640,00
Валовый убыток	-\$ 138 980,00	-\$ 122 445,00	-\$ 16 535,00
Коэффициент прибыли	1,38	1,42	1,13
Общее количество сделок	735	559	176
Процент рентабельности	54,56%	56,53%	48,30%
Прибыльные сделки	401	316	85
Убыточные сделки	327	240	87
Безубыточные сделки	7	3	4
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 72,45	\$ 91,49	\$ 11,96
Сред. прибыльная сделка	\$ 479,38	\$ 549,34	\$ 219,29
Сред. убыточная сделка	-\$ 416,11	-\$ 510,19	-\$ 190,06
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,15	1,08	1,15
Макс. просадка	\$ 6 765,00		

2. Энергоносители

Энергоносители – моя вторая любимая категория рынка. Они всегда находятся в движении, и торгуя на них, вы можете получить очень хорошую прибыль. В секторе фьючерсов на энергоносители задействовано много денег. Просто учитывайте, что на этих рынках более высокая волатильность.

Предлагаю стратегию торговли на колебаниях на природном газе (NG) на 80-минутном таймфрейме с отличным соотношением чистой прибыли к максимальной просадке, большим размером выборки и отличными средними результатами сделки.



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 105 700,00	\$ 30 480,00	\$ 75 220,00
Валовая прибыль	\$ 381 360,00	\$ 107 510,00	\$ 273 850,00
Валовый убыток	-\$275 660,00	-\$ 77 030,00	-\$ 198 630,00
Коэффициент прибыли	1,38	1,40	1,38
Общее количество сделок	966	491	475
Процент рентабельности	45,55%	39,71%	51,58%
Прибыльные сделки	440	195	245
Убыточные сделки	524	294	230
Безубыточные сделки	2	2	0
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 109,42	\$ 62,08	\$ 158,36
Сред. прибыльная сделка	\$ 866,73	\$ 551,33	\$ 1 117,76
Сред. убыточная сделка	-\$ 524,07	-\$ 262,01	-\$ 863,61
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,65	2,10	1,29
Макс. просадка	\$ 9 050,00		

3. Зерно

Я также очень люблю зерновые, особенно по причине их крайне низкой корреляции с индексами или энергоносителями. В нашей базе данных есть много стратегий торговли на зерне, и мы регулярно торгуем на них. Предлагаю пример стратегии торговли на колебаниях на соевых бобах (S) на 80-минутном таймфрейме.

Все параметры этой стратегии являются довольно хорошими. Мы постоянно используем данную стратегию торговли в нашем хедж-фонде.



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 72 812,50	\$ 57 337,50	\$ 15 475,00
Валовая прибыль	\$165 162,50	\$130 237,50	\$34 925,00
Валовый убыток	-\$ 92 350,00	-\$ 72 900,00	-\$ 19 450,00
Коэффициент прибыли	1,79	1,79	1,80
Общее количество сделок	445	316	129
Процент рентабельности	37,08%	43,99%	20,16%
Прибыльные сделки	165	139	26
Убыточные сделки	277	174	103
Безубыточные сделки	3	3	0
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 163,62	\$ 181,45	\$ 119,96
Сред. прибыльная сделка	\$ 1 000,98	\$ 936,96	\$1 343,27
Сред. убыточная сделка	-\$ 329,82	-\$ 418,97	-\$188,83
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	3,03	2,24	7,11
Макс. просадка	\$ 7 837,50		

4. Металлы

Металлы – ещё одна захватывающая категория рынка. Хотя золото (GC) является самым популярным, другие рынки в этом секторе тоже могут быть полезными. Например, серебро (SI). Предлагаю стратегию торговли на колебаниях на серебре на 80-минутном таймфрейме. Высокая

производительность вне выборки, отличное соотношение чистой прибыли к максимальной просадке, отличные средние результаты сделки.

Как длинные, так и короткие сделки демонстрируют одинаково хорошие результаты.



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 106 625,00	\$ 54 250,00	\$ 52 375,00
Валовая прибыль	\$ 297 365,00	\$ 135 115,00	\$ 162 250,00
Валовый убыток	-\$ 190 740,00	-\$ 80 865,00	-\$ 109 875,00
Коэффициент прибыли	1,56	1,67	1,48
Общее количество сделок	457	193	264
Процент рентабельности	66,52%	67,88%	65,53%
Прибыльные сделки	304	131	173
Убыточные сделки	153	62	91
Безубыточные сделки	0	0	0
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 233,32	\$ 281,09	\$ 198,39
Сред. прибыльная сделка	\$ 978,17	\$ 1 031,41	\$ 937,86
Сред. убыточная сделка	-\$ 1 246,67	-\$ 1 304,27	-\$ 1 207,42
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	0,78	0,79	0,78
Макс. просадка	\$ 7 400,00		

5. Мягкие товары

Этот сектор может быть немного сложным и лучше всего подходит для торговли, когда у вас уже будет некоторый опыт работы с формулой и в трейдинге в целом. Я рекомендую оставить его на потом, но вы можете создавать некоторые удивительные стратегии в этом секторе. К тому же у них, как правило, очень низкая корреляция с индексами, энергоносителями или металлами.

Как только вы научитесь справляться со сложностями, мягкие товары могут стать ещё одним отличным сектором для вашего будущего **глобального** бизнеса. Предлагаю пример стратегии торговли на колебаниях на **кофе** на 30-минутном таймфрейме, в которой короткие сделки демонстрируют более высокую производительность:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 119 362,50	\$ 13 818,75	\$ 105 543,75
Валовая прибыль	\$ 323 175,00	\$ 43 218,75	\$ 279 956,25
Валовый убыток	-\$ 203 812,50	-\$ 29 400,00	-\$ 174 412,50
Коэффициент прибыли	1,59	1,47	1,61
Общее количество сделок	529	57	472
Процент рентабельности	51,61%	54,39%	51,27%
Прибыльные сделки	273	31	242
Убыточные сделки	253	26	227
Безубыточные сделки	3	0	3
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 225,64	\$ 242,43	\$ 223,61
Сред. прибыльная сделка	\$ 1 183,79	\$ 1 394,15	\$ 1 156,84
Сред. убыточная сделка	-\$ 796,14	-\$ 1 130,77	-\$ 768,34
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,49	1,23	1,51
Макс. просадка	\$ 8 493,75		

6. Валюты

На валютах, если говорить в целом, торговать тяжело. Это ещё одна причина, почему я действительно не люблю рынок Форекс и не торгую на нём. Тем не менее, с помощью моей формулы вы можете создавать некоторые приличные стратегии торговли на пробоях на валютных фьючерсных рынках. Наберитесь терпения.

Предлагаю стратегию торговли на колебаниях на японской иене (JY) на 60-минутном таймфрейме:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 112 706,25	\$ 47 518,75	\$ 65 187,50
Валовая прибыль	\$ 347 037,50	\$ 147 712,50	\$ 199 325,00
Валовый убыток	-\$ 234 331,25	-\$ 100 193,75	-\$ 134 137,50
Коэффициент прибыли	1,48	1,47	1,49
Общее количество сделок	920	364	556
Процент рентабельности	45,11%	45,33%	44,96%
Прибыльные сделки	415	165	250
Убыточные сделки	505	199	306
Безубыточные сделки	0	0	0
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 122,51	\$ 130,55	\$ 117,24
Сред. прибыльная сделка	\$ 836,23	\$ 895,23	\$ 797,30
Сред. убыточная сделка	-\$ 464,02	-\$ 503,49	-\$ 438,36
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,80	1,78	1,82
Макс. просадка	\$ 9 400,00		

7. Мясо

В базе данных нашего хедж-фонда имеется только 15 стратегий торговли на рынке мяса. Причина в том, что этот сектор рынка, как правило, не подходит для торговли хедж-фондов из-за его низкой ликвидности. Тем не менее, торговля несколькими контрактами не должна быть проблемой для вас.

Предлагаю пример стратегии торговли на колебаниях на свинине (LH) на 80-минутном таймфрейме:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 50 820,00	\$ 25 550,00	\$ 25 270,00
Валовая прибыль	\$ 129 890,00	\$ 59 740,00	\$ 70 150,00
Валовый убыток	-\$ 79 070,00	-\$ 34 190,00	-\$ 44 880,00
Коэффициент прибыли	1,64	1,75	1,56
Общее количество сделок	480	206	274
Процент рентабельности	57,08%	58,25%	56,20%
Прибыльные сделки	274	120	154
Убыточные сделки	200	83	117
Безубыточные сделки	6	3	3
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 105,88	\$ 124,03	\$ 92,23
Сред. прибыльная сделка	\$ 474,05	\$ 497,83	\$ 455,52
Сред. убыточная сделка	-\$ 383,83	-\$ 411,93	-\$ 383,59
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,24	1,21	1,19
Макс. просадка	\$ 3 890,00		

8. Облигации

Облигации – это жёсткие рынки. Я не рекомендую начинать с них. Оставьте их на самую последнюю очередь. Это пример стратегии торговли на колебаниях на 10-летних казначейских облигациях США (TY) на 240-минутном таймфрейме, которую мы постоянно используем для торговли в нашем хедж-фонде:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 29 093,79	\$ 26 906,28	\$ 2 187,51
Валовая прибыль	\$ 67 453,59	\$ 43 968,90	\$ 23 484,69
Валовый убыток	-\$ 38 359,80	-\$ 17 062,62	-\$ 21 297,18
Коэффициент прибыли	1,76	2,58	1,10
Общее количество сделок	396	124	272
Процент рентабельности	52,02%	59,68%	48,53%
Прибыльные сделки	206	74	132
Убыточные сделки	168	47	121
Безубыточные сделки	22	3	19
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 73,47	\$ 216,99	\$ 8,04
Сред. прибыльная сделка	\$ 327,44	\$ 594,17	\$ 177,91
Сред. убыточная сделка	-\$ 201,89	-\$ 363,03	-\$ 176,01
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,62	1,64	1,01
Макс. просадка	\$ 2 828,14		

9. Европейские рынки

И, наконец... Мне очень нравятся европейские фьючерсные рынки. Платформа TradeStation дает нам возможность торговать на некоторых из них. На них очень хорошо торговать с помощью моей формулы. Предлагаю пример стратегии торговли на колебаниях на еврооблигациях (FGBL), предназначенной для 90-минутного таймфрейма:



	Все сделки	Длинные сделки	Короткие сделки
Суммарная чистая прибыль	\$ 38 680,00	\$ 36 060,00	\$ 2 620,00
Валовая прибыль	\$ 104 200,00	\$ 92 930,00	\$ 11 270,00
Валовый убыток	-\$ 65 520,00	-\$ 56 870,00	-\$ 8 650,00
Коэффициент прибыли	1,59	1,63	1,30
Общее количество сделок	475	300	175
Процент рентабельности	53,05%	54,00%	51,43%
Прибыльные сделки	252	162	90
Убыточные сделки	213	137	76
Безубыточные сделки	10	1	9
Сред. чистая прибыль в сделке	\$ 81,43	\$120,20	\$ 14,97
Сред. прибыльная сделка	\$ 413,49	\$ 573,64	\$ 125,22
Сред. убыточная сделка	-\$ 293,81	-\$ 415,11	-\$ 113,82
Соотношение сред. прибыльной сделки к сред. убыточной сделке	1,41	1,38	1,10
Макс. просадка	\$ 4 710,00		

Теперь у вас есть практическое вдохновение для ваших торговых целей, иллюстрирующее, что всё является возможным.

Далее давайте поговорим об успехе других трейдеров, таких же, как вы, которые имели привилегию освоить формулу Мистера Пробои и использовать её для создания своих собственных личных революций.

Торговля с помощью формулы «По всему миру»

Создание мощных прибыльных пробойных торговых стратегий на американских фьючерсных рынках с помощью формулы Мистера Пробои практически является «данью».

Тем не менее, что меня действительно удивляет, так это то, как волшебным образом эта формула работает буквально на любых мировых рынках. Это ещё раз доказывает, насколько универсальной является данная формула, и вы действительно должны свободно применять её к любому рынку или таймфрейму, который вы захотите, и в любой стране, которую вы захотите.

Поэтому, поделившись своим огромным успехом на большинстве крупных американских рынков, я хотел бы поделиться с вами некоторыми **реальными** историями успеха трейдеров, применяющих формулу Мистера Пробои на зарубежных рынках. Некоторые из них являются довольно экзотичными (по крайней мере, для меня!)

Первая история, которой я хотел бы поделиться с вами – это история Хенрика из Швеции. Она очень поучительна по нескольким причинам. Во-первых, Хенрик является одним из первых последователей формулы Мистера Пробои в Европе. Он торгует по этой формуле с 2018 года.

Во-вторых, Хенрик применил эту формулу на шведских рынках, которые являются довольно маленькими и довольно необычными рынками для торговли, и, тем не менее, он добился там удивительного успеха.

И, наконец, Хенрик также является соучредителем общества Nordic Autotrading Society, а это значит, что он является тем парнем, которого нелегко обмануть дешёвыми уловками. Будучи трейдером с глубоким пониманием и опытом, Хенрик видел многое, в том числе опыт членов его общества.

Таким образом, его отзывы многое значат для меня – и для вас, – и его опыт должен только добавить ещё больше доверия к силе формулы Мистера Пробои.

Хенрик начал применять данную формулу в 2018 году, и ему потребовалось всего несколько дней, чтобы разработать свои первые 200 пробойных торговых стратегий. (Да, вы всё правильно прочитали: 200 стратегий всего за несколько дней!)

Он был так воодушевлён этим успехом, что сразу же отправил нам невероятное свидетельство:

«Работает так, как он описывает».

Цитата

«Как торговый педагог в Nordic Autotrading Society и активный трейдер, в основном ориентированный на европейские рынки, я очень впечатлён.

Как разработчик стратегий я всегда ищу новые идеи, как сделать те или иные вещи. Я протестировал бесчисленное количество идей и стратегий из Интернета. Некоторые из них работают, а многие нет. После завершения и тестирования контента Томаса я был с радостью удивлён, что эта формула действительно работает. И самое удивительное то, что многие вещи, описанные Томасом, работают именно так, как он описывает.

Несмотря на то, что я использую совершенно другую платформу и мне пришлось внести некоторые корректировки и переписать код, простота идей не уменьшила ценности данного курса.

Самым лучшим является простота и красота самой структуры торговли на пробоях наряду с автоматизированным процессом её проектирования. Всего за несколько дней, максимум неделю, у меня уже было примерно 200 торговых стратегий, которые я вписал в свой собственный смарт-код для бэктестирования и запуска в режиме реального времени.

Этот курс определённо стоит денег и времени».

*Хенрик
Учредитель Nordic Autotrading Society*

Но на этом история не заканчивается. Вовсе нет.

Всего несколько месяцев спустя (25 апреля 2018 года) Хенрик снова связался со мной и Эндрю. И на этот раз он поделился с нами тем, как с помощью данной формулы совершил путешествие на Канарские острова:

Цитата

Хенрик, 06.04.2018, 12:36

кому: Эндрю, мне

Привет!

Вчера я прилетел в Испанию (на один из Канарских островов). Отключил роботов и в течение нескольких часов пребывал в автономном режиме. После приземления я снова включил роботов. Пробойные стратегии адаптировались, поскольку был большой отскок в Европе и на Уолл-стрит.

К ужину моя поездка уже была оплачена. Очевидно, данный метод работает хорошо. Кривая капитала продолжает расти, а индекс демонстрирует боковое или нисходящее движение.

Мой следующий шаг – протестировать её на фондовом рынке.

Наслаждаюсь своим отпуском, оплаченным с помощью автоматизированных пробойных стратегий. 😊

Неплохое начало применения данной формулы, не так ли?

Но и это еще не всё. Затем, 25 мая, мы снова получили письмо от Хенрика, и на этот раз он сообщил нам о своём продолжающемся успешном применении нашей формулы.

Цитата

Хенрик, 25.05.2018, 0:19

кому: Эндрю, мне

Приветствую!

Безумие, но волшебство по-прежнему работает. Стратегии, среди которых пробойные находятся в явном большинстве, являются движущей силой совокупного среднегодового темпа роста.

Я ещё в Испании, и ваша формула прекрасно работает. Никаких откатов. Комбинация классической пробойной стратегии с разворотной пробойной стратегией добавляет новое измерение. Утром у вас может быть жирная короткая позиция, которая закрывается целым рядом разворотов. Стратегии прикрывают друг друга.

Это бездонная банка комбинаций. Единственная проблема, которая у меня возникла – это найти достаточно времени для изучения всех этих идей. 😊

Затем мы получили еще одно электронное письмо, где он поделился с нами **своими** результатами торговли с **февраля по июнь**. Всего за 5 месяцев, будучи полным новичком в формуле, он уже заработал +30,55%. Вот скриншоты, которыми он поделился с нами:

Zoom: 1M 3M All Feb 6, 2018 / Jun 20, 2018

Toggle Benchmarks

Monthly Returns 41.6% 15 May 2018

Cumulative Equity



Monthly Performance

Upload unverified data

Edit daily returns

Click any month in table to see close up chart for that month

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Total
2018		17.71%	6.57%	7.39%	-3.47%	0.39%							30.55%

Суммарный капитал с ежемесячной доходностью:

Среднегодовая доходность	106,69
Среднегодовая волатильность	39,20
Коэффициент Шарпа	2,72
Ожидаемый убыток	-3,72%
Подверженность риску	-2,21%
Совокупная доходность	30,54%
Максимальная просадка	11,31%
Коэффициент Сортино/ $\sqrt{2}$	4,29
Асимметричность распределения	3,51
Среднесуточная доходность	0,31%
FS Score	Н/д
Ежедневный GPR	0,62
Ежемесячный GPR	8,23
Коэффициент эксцесса распределения	23,79
Суточное стандартное отклонение	2,42%

Но **подождите**.

Возможно, вы подумаете, что всё это может быть связано с удачей. Если это так, то вы очень недооцениваете силу формулы Мистера Пробои!

Хенрик продолжал давать нам обратную связь в течение следующих лет. Последнее его письмо было получено в ноябре 2021 года. В нем Хенрик подтвердил, что данная формула (те же стратегии, которые он создал в 2018 году) **по-прежнему отлично работает у него**, и еще он протестировал эту формулу на фондовом рынке и тоже получил хорошие результаты:

Цитата

Хенрик

кому: Эндрю, мне

Привет, ребята!

Вы всё еще крутитесь и вертитесь. Ваши подкасты являются неотъемлемой частью моей прогулки на работу. Я сменил работу и являюсь генеральным директором компании. Трейдинг по-прежнему занимает большую часть моей жизни (если бы это было прописано в моём контракте).

В 2018 году я создал кучу пробойных стратегий, и многие из них действительно работают очень хорошо. Мы также реализовали преимущества пробойных стратегий в торговле на колебаниях на различных рынках и в комбинации с рейтинговыми движками (пробой является действительным, если актив занимает первое место). Мы также протестировали эти стратегии на фондовом рынке и убедились, что там они тоже успешно работают.

Итак, как вы можете видеть, четыре года спустя формула Мистера Пробои по-прежнему успешно работает у Хенрика (как и у **многих** других её ранних последователей).

Она продолжает работать у них, потому что эта формула **безупречна**. И она **неподвластна времени**. Она работала в прошлом, работает сейчас и будет продолжать работать в будущем. С формулой Мистера Пробои у вас **наконец** есть надёжный универсальный подход к построению **действительно** жизнеспособного долгосрочного бизнеса в трейдинге.

На этом ваши поиски заканчиваются. Теперь у вас есть окончательный билет к вашей торговой **свободе**. Добро пожаловать!

Теперь перенесёмся из Швеции в... **Россию**.

Несколько лет назад мы с Эндрю создали небольшой курс по разработке стратегий торговли на пробоях Breakout Challenge с целью помочь трейдерам начать создавать жизнеспособные торговые стратегии всего за 14 дней. (Разумеется, с помощью нашей формулы.)

У нас были люди со всего мира, и одним из них был Владимир из России. Я понятия не имел, что в нашей группе есть трейдеры из России, пока не получил электронное письмо от Владимира, где он поделился тем, как применял формулу на российских фьючерсных рынках и с её помощью зарабатывал +55% в год.

Он даже поделился всеми подробностями: он использовал 15-минутный таймфрейм, его ТИ была цена закрытия предыдущего дня (CloseD(1)), для **пространства** он рассчитал 3x ATR, а затем добавил трейлинг стоп-лосса.

Вот так. (Вы тоже можете создать подобную стратегию, не так ли?)

В феврале 2020 года он отправил нам письмо следующего содержания:

Цитата

Отзыв о «14-дневном курсе по разработке стратегий торговли на пробоях»

Владимир Чамин, 12.02.2020, 10:26

Здравствуйте, Томас!

Меня зовут Владимир.

Я алготрейдер и коуч из России. Мой сайт - _____.

В августе прошлого года я купил ваш «14-дневный курс по разработке стратегий торговли на пробоях» и использую эту информацию для себя и своих клиентов на российском фьючерсном рынке.

Хочу показать вам капитал одного из моих главных клиентов.

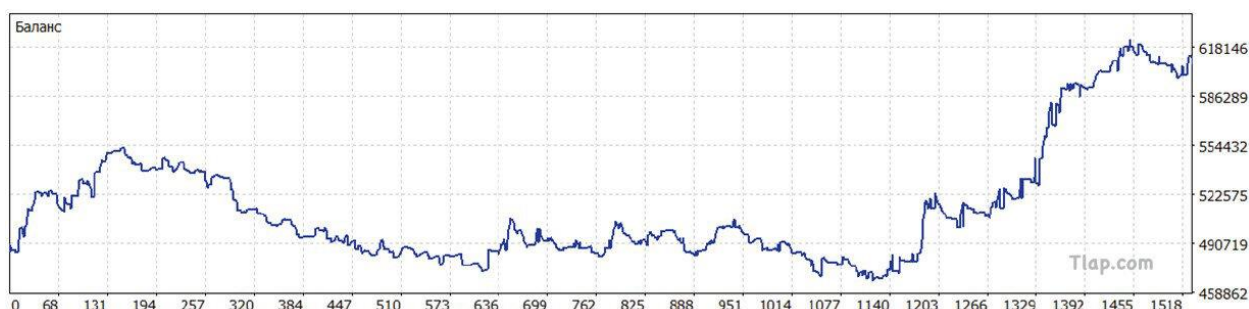
Первоначальный капитал 490 000 руб. (прибл. \$7 500). На сегодняшний день он имеет прибыль в размере 128 000 руб. (\$2 000) за 5 месяцев, или ~55% годовых, при максимальной просадке 13%.

Он использует: таймфрейм = m15, TI = closeD(1), пространство = 3 ATR, трейлинг стоп-лосса и тейк-профита, futures = Si (USD/RUB), Eu (EUR/RUB). Br (brent), Ri (фондовый индекс РТС).

Спасибо вам большое за помощь!

С уважением, Владимир

Кроме того, он даже приложил **свою** кривую торгового капитала:



Я знаю, что вы, вероятно, думаете: кривая капитала Владимира в режиме реальной торговли выглядит «так себе», учитывая, как долго он находился в небольшой просадке. И я понимаю вас: в каком-то смысле вы правы. Однако учтите следующее: во-первых, эта формула никогда не тестировалась на таких экзотических рынках, как российский. Во-вторых, каждому новому инструменту требуется некоторое время, чтобы он работал гладко и хорошо.

Так что, скорее всего, часть этой кривой обучения тоже выражается в кривой капитала.

И, наконец, помните: ключевым фактором является **глобализация**. Хотя торговля на четырёх рынках с помощью моей формулы является хорошим началом, вам всё равно нужно стремиться к более крупным портфелям среди очень низкоррелированных рынков. Тогда у вас будет лучший шанс свести продолжительность просадки к минимуму.

Тем не менее, годовой доход +55% намного лучше, чем обычные 0-1%, которые вы получаете в банке! Особенно учитывая, что вы можете полностью автоматизировать свои стратегии и позволить вашему компьютеру выполнять всю работу за вас.

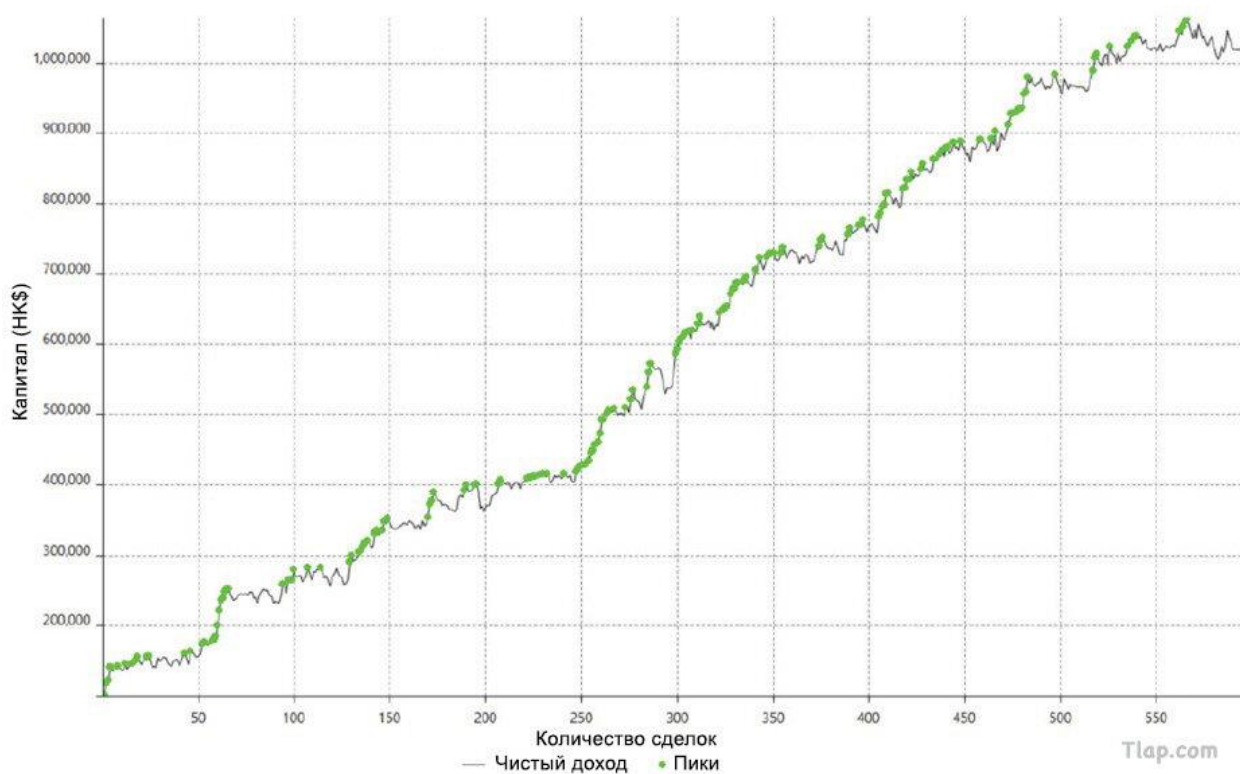
Не знаю, как у вас, но у меня она работает!

И, наконец, хочу поделиться с вами тем, что я считаю самым удивительным примером возможностей формулы Мистера Пробои на сегодняшний день. Это удивительное достижение исходит от одного из моих самых ранних и самых преданных сотрудников – того, кто был одним из первых, кто принял эту формулу, и теперь освоил её до такой степени, что может применять её где угодно и в любое время.

Кроме того, этот «некто» уже имеет очень хорошее имя в индустрии трейдинга, будучи известным своей абсолютной прозрачностью, честностью и доверием. Конечно же, я говорю о моем друге Эндрю Суонскотте, который, возможно, является единственным трейдером, который заставил формулу Мистера Пробои работать на азиатских индексах.

Вот что он сделал и чего достиг там на сегодняшний день:

Индекс Hang Seng (Гонконгская фондовая биржа).



Капитал (HK\$)

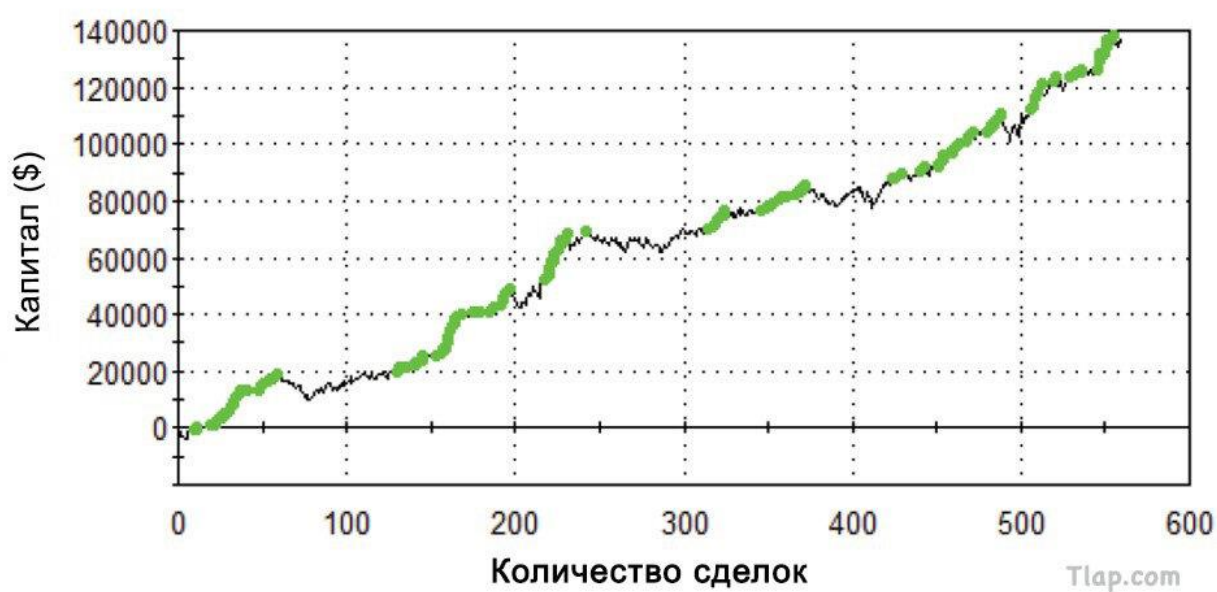
Количество сделок

Чистый доход

Пики

Индекс SPI (Австралия):

Кривая капитала - +CSV:SPI.CSV 45 min.(1/2/2009 10:20 - 6/4/2021 15:30)

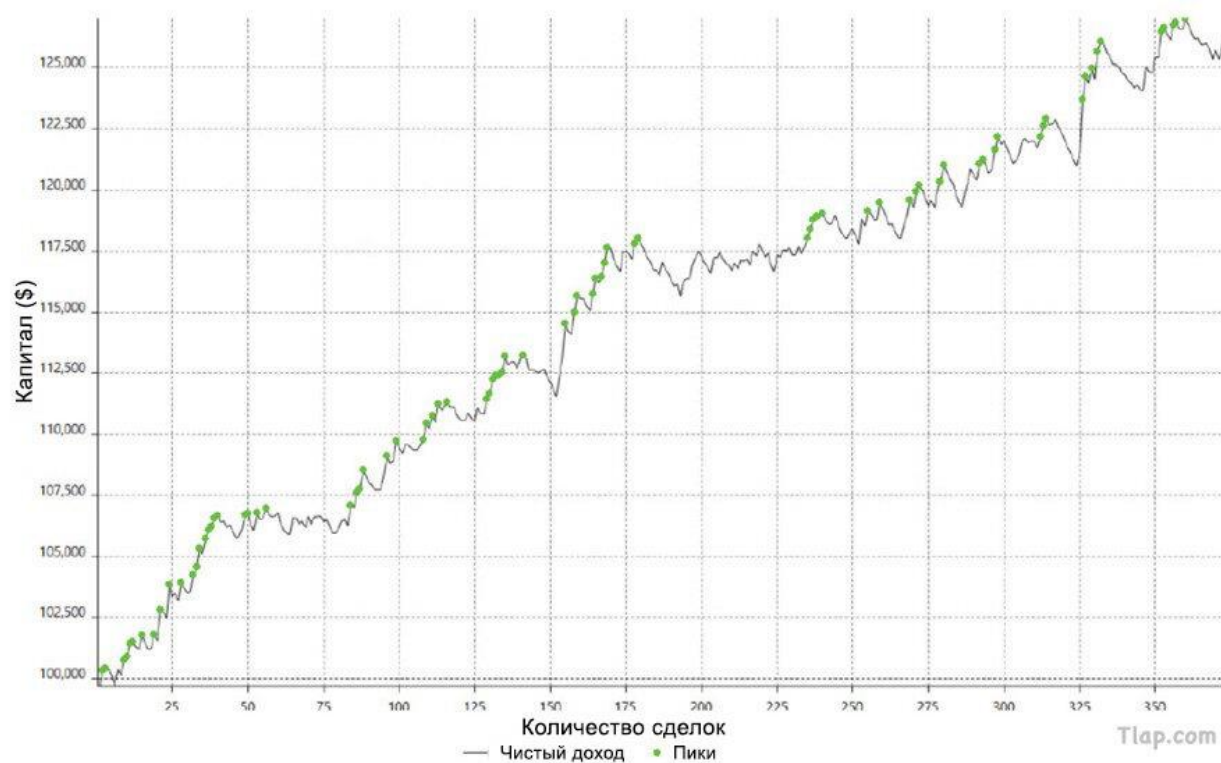


Кривая капитала

Капитал (\$)

Количество сделок

Индекс MSCI Singapore:



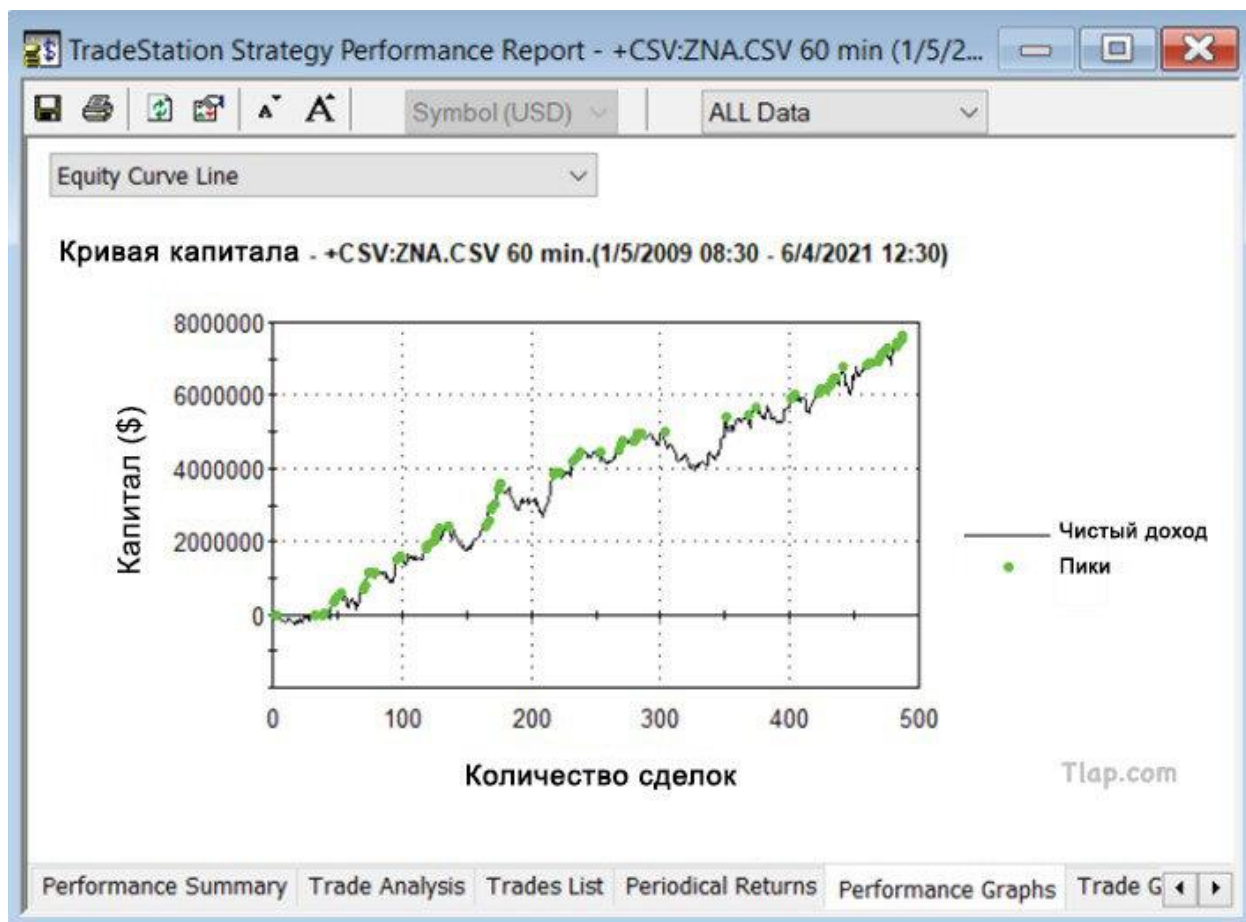
Капитал (\$)

Количество сделок

Чистый доход

Пики

Индекс Nikkei (Сингапур):



Кривая капитала
Капитал (\$)
Количество сделок
Легенда
Чистый доход
Пики

Неплохо, верно?

Очень надеюсь, что вам понравились эти примеры «по всему миру». Смысл этой главы должен быть довольно очевидным и простым: формула Мистера Пробои работает как шарм даже за пределами американских рынков. Она **невероятно** универсальна. И она оплачивает семейный отдых (иногда очень быстро), а также некоторые забавные игрушки (как вы прочитаете в следующей главе).

Где и как вы решите использовать её, полностью зависит от вас. Однако для этого есть одно **правило**:

Вы должны применять её.

Вы должны начать. Ничего не случится, если вы просто сядете сложа руки, позволяя скептицизму помешать вам даже попытаться улучшить свою жизнь. Истинная революция требует усилий, действий и самоотверженности. Но также веры и оптимизма. Тогда даже невозможное становится возможным... И иногда вещи движутся быстрее, чем вы можете себе представить!

Не упустите свой шанс, пожалуйста. В настоящее время высокой инфляции, постоянно растущих цен на всё и грядущего экономического кризиса, который не за горами, у вас должен быть план Б. И **это** может быть он. Но только если вы начнёте.

Далее я поделюсь с вами двумя очень вдохновляющими интервью с парнями, которые буквально освоили формулу Мистера Пробои и достигли невероятного успеха с ней. Оба интервью были первоначально опубликованы в Информационном бюллетене вдохновленного трейдера (Empowered Trader Newsletter) и немного отредактированы и сокращены для этой книги.

От убытков до миллиона

Среди бесчисленных историй успеха от трейдеров со всего мира, торгующих с помощью формулы Мистера Пробои, моей любимой является история Адама.

Во-первых, потому что Адам – «нормальный» парень, как и я. Непринуждённый австралиец с «вольным духом». Никакого изысканного образования. У него даже нет технических или инженерных знаний, которые обычно имеются у алгоритмических трейдеров. Адам выучил код EasyLanguage с нуля и начал свою торговую карьеру, параллельно работая **пожарным**.

Во-вторых, потому что он любит наслаждаться деньгами, которые зарабатывает в трейдинге, так же, как и я! На первые деньги, которые он заработал с помощью формулы Мистера Пробои, он купил гидроцикл.

Адам изучил эту формулу в 2018 году. В то время он был трейдером-неудачником, постоянно пробовавшим разные подходы. С тех пор он освоил все аспекты формулы. За это время его счёт вырос с \$50 тысяч до \$1,2 **миллиона**.

В перерывах между торговлей Адама можно найти в океане, гонящегося за волнами и занимающегося практически любым видом океанского спорта, о котором только можно подумать, или проводящего время со своей семьей. Его нынешняя одержимость – катер на подводных крыльях и его многочисленные применения на воде.

Для меня большая честь представить вам это очень вдохновляющее интервью. История Адама наглядно показывает, какой **успех** и какую личную революцию может принести в вашу жизнь формула Мистера Пробои.

Как проходила ваша торговля до формулы Мистера Пробои, и каких успехов вы достигли с тех пор? Каким был ваш торговый капитал до этого, и каким количеством денег вы управляете сейчас?

До того, как я присоединился к Академии лучшего трейдера [Better Trader Academy (BTA)], моя торговля была собачьим завтраком. Я не умру от удивления, потому что я перепробовал всё.

Моей первой позицией на сумму \$500 была покупка копеечной акции австралийской фармацевтической компании под названием Probiotec. Затем я получил наводку от друга о горнодобывающей компании, которая занималась медицинской марихуаной, и на ней у меня всё пошло кувырком. Я всё продумал. Аккумуляторная революция, месторождения лития в глубинке Австралии, уран, продажа сухого молока в Китай. Я узнал всё об этой копеечной акции, кроме того, как заработать на ней деньги.

Я попробовал свои силы в фундаментальных данных, прочитал несколько книг по паттернам и даже на некоторое время подписался на получение инсайдерской информации, дававшей рекомендации относительно покупки тех или иных акций. Моя идея исследования заключалась в том, чтобы получать всевозможные советы на онлайн-форумах, таких как Hotcopper. На моём торговом счёте было 20k AUD, и я терпел несколько просадок в 50-60%, но каждый раз мне

удавалось всё полностью вернуть. Это было связано с чистой удачей и временем бычьих рынков, а не с навыком или хорошим стилем торговли.

Я пришёл к пониманию, что если бы я хотел торговать в долгосрочной перспективе, я не мог бы продолжать торговать в таком стиле. Примерно в то же время я начал слушать подкаст Эндрю Суонскотта «Лучший системный трейдер» и заинтересовался системным трейдингом. Я знал, что это единственный способ, которым я смогу торговать, не слив свой счёт. Я потратил довольно много времени, пытаясь построить очень простые торговые стратегии в Excel, делая ручной ввод данных. Чтобы протестировать одну стратегию на данных за 1 год, мне в буквальном смысле требовалось 2-3 недели.

В своем подкасте Эндрю упомянул о ВТА, и на следующий день я подписался на него. Каждый курс ВТА я проходил как можно быстрее, и спустя 3 года я уже торгую на счете размером в \$1,2 **миллиона**. Это определённо было не плавное путешествие. Долгие часы, сногшибательная тяжёлая работа и решимость компенсировали то, чего мне не хватало в некоторых из необходимых навыков, которые имеются у большинства других трейдеров.

Насколько большим является ваш портфель в настоящее время? Какова его структура с точки зрения рыночных категорий, рынков, колебаний и стратегий внутридневной торговли?

На сегодняшний день мой текущий портфель пробойных стратегий насчитывает 55 стратегий.

Я торгую на всех секторах фьючерсных рынков и следующих фьючерсных рынках: евро (EC), австралийском долларе (AD), кукурузе (C), какао (CC), канадском долларе (CD), сырой нефти (CL), хлопке (CT), Emini S&P 500 (ES), скоте на откорме (FC), евробондах (FGBL), золоте (GC), высококачественной меди (HG), топочном мазуте (HO), японской иене (JY), кофе (KC), живом скоте (LC), свинине (LH), Emini NASDAQ (NQ), платине (PL), Emini Crude Oil (QM), реформулированном целевом компоненте для насыщения бензина кислородом (RB), Emini Russell (RTY), соевых бобах (S), облигациях США (US), пшенице (W), Emini Dow Jones (YM). И ещё некоторые рынки находятся в стадии разработки для запуска в течение следующих нескольких недель.

Для нормализации всех стратегий я использую системный подход Томаса и небольшое наложение фиксированных долей капитала. Я бы сказал, что около 85% стратегий используется в свинг-трейдинге и около 15% – во внутридневном трейдинге. Я предпочитаю свинг-трейдинг. Все стратегии являются довольно стандартными, прямо из материала курса ВТА. Я не исследователь и довольно лояльно отношусь к мастер-классам Томаса по стратегиям торговли на пробоях. Если стратегия работает, не вносите в неё корректировки.

Каковы ваши ключевые критерии при построении торговых стратегий? И как выглядит ваш процесс построения стратегии?

На данный момент моими ключевыми критериями является поиск стратегий, не связанных с остальной частью моего портфеля, потому что это единственные стратегии, которые мне нужны. Это становится всё сложнее, поскольку я уже использую очень много торговых стратегий, но это не является невозможным. Я начинаю с определения стратегий, которые логически будут хорошо подходить, то есть новый актив, сектор, сессия, интервал или выход и т. д.

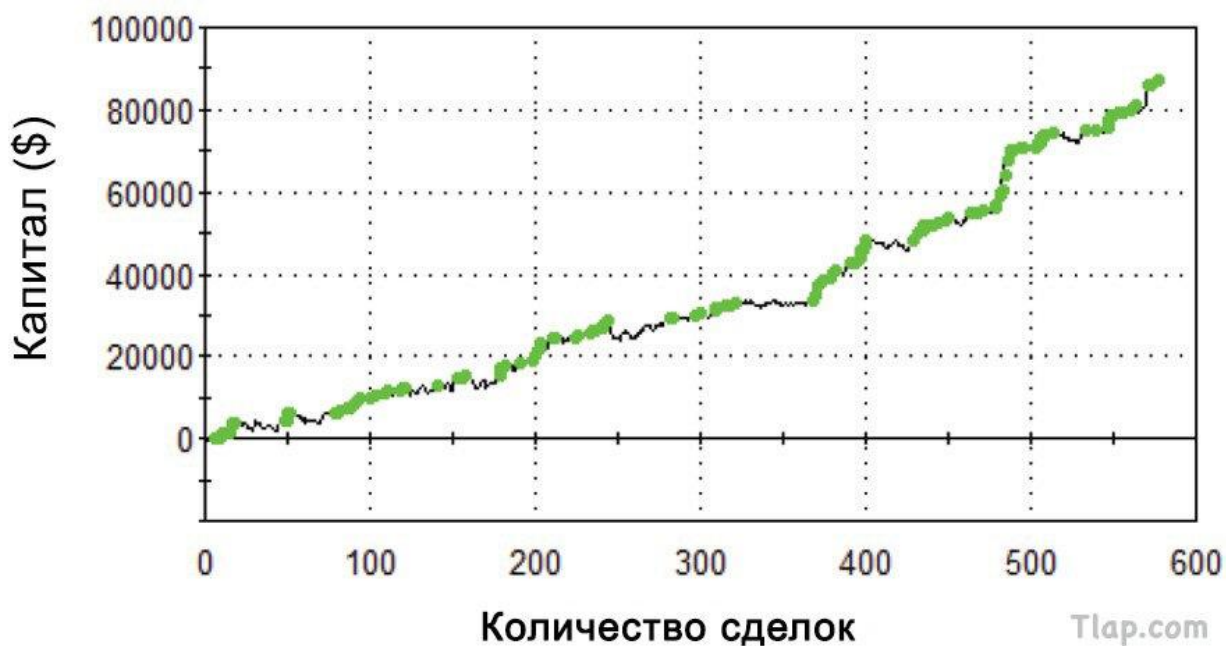
За эти годы мой созидательный процесс сильно изменился. Прямо сейчас я провожу тесты «на пробу», или зондирование почвы, как я их называю. Во-первых, я тестирую интервал, сессию, функцию пригодности и т. д. И смотрю, что из этого работает. Затем я беру эту информацию и запускаю 2-й шаг, который включает ТИ («точку инициации» – часть формулы Мистера Пробои), фильтры и выходы.

Можете ли вы поделиться кривыми капитала нескольких ваших пробойных торговых стратегий, которые вы разработали с помощью формулы Мистера Пробои? Как они обычно выглядят? Не могли бы вы немного прокомментировать их?

Все любят хорошие кривые капитала, и я бы солгал, если бы сказал, что не являюсь одним из них. Вот некоторые из моих лучших.

Crude Boy

Кривая капитала - @CL 60 min.(1/2/2009 09:00 - 1/26/2022 14:30)

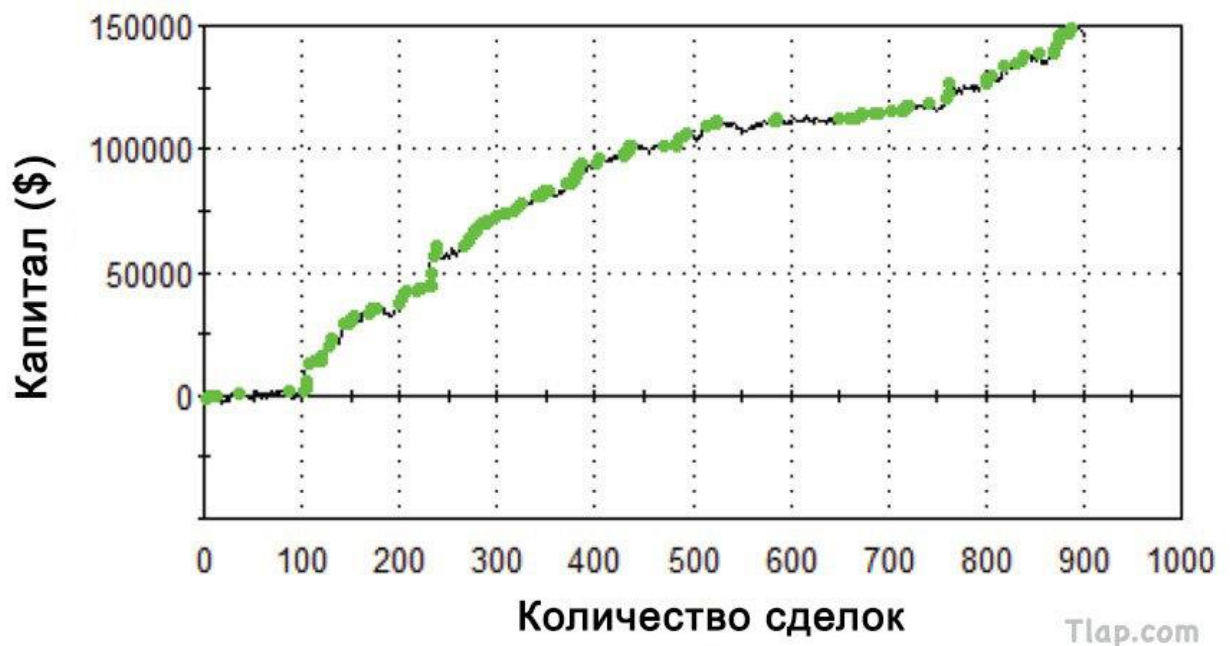


Кривая капитала
Капитал (\$)
Количество сделок

Это стратегия внутридневной торговли.

Golden Boy

Кривая капитала - @GC 60 min.(11/4/2008 04:25 - 1/26/2022 13:25)



Кривая капитала
Капитал (\$)
Количество сделок

Golden Boy – мой давний фаворит, и я торгую на этой стратегии уже много лет. Это внутридневная торговля на более длинной сессии. Фактически это была моя звездная стратегия во время обвала рынка в начале пандемии Covid в феврале/марте 2020 года.

Yentastic

Кривая капитала - @JY 90 min.(3/28/2008 02:30 - 1/26/2022 14:30)

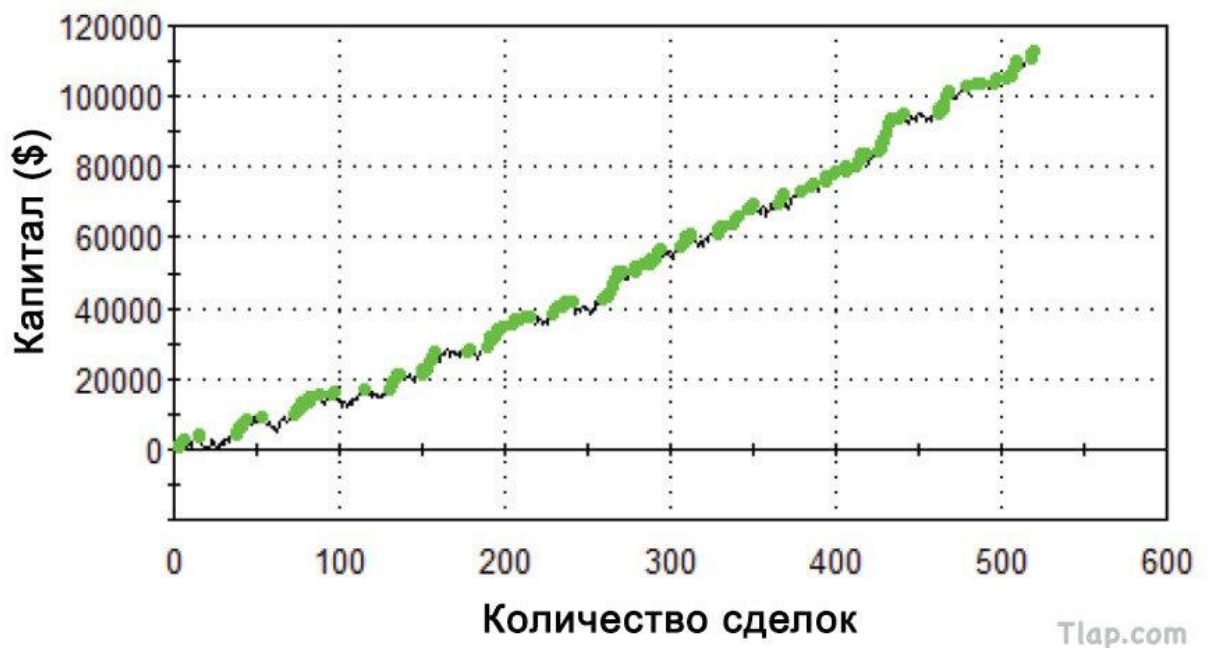


Кривая капитала
Капитал (\$)
Количество сделок

Yentastic – ещё одна стратегия из моих давних фаворитов. Это свинг-трейдинговая стратегия с длительной сессией. Йена является самой простой валютой для разработки стратегий. В течение последних нескольких лет он была стабильно прибыльной, практически без просадки (как видно из кривой капитала).

ES Glider

Кривая капитала - @ES 15 min.(1/2/2009 08:45 - 1/26/2022 15:15)

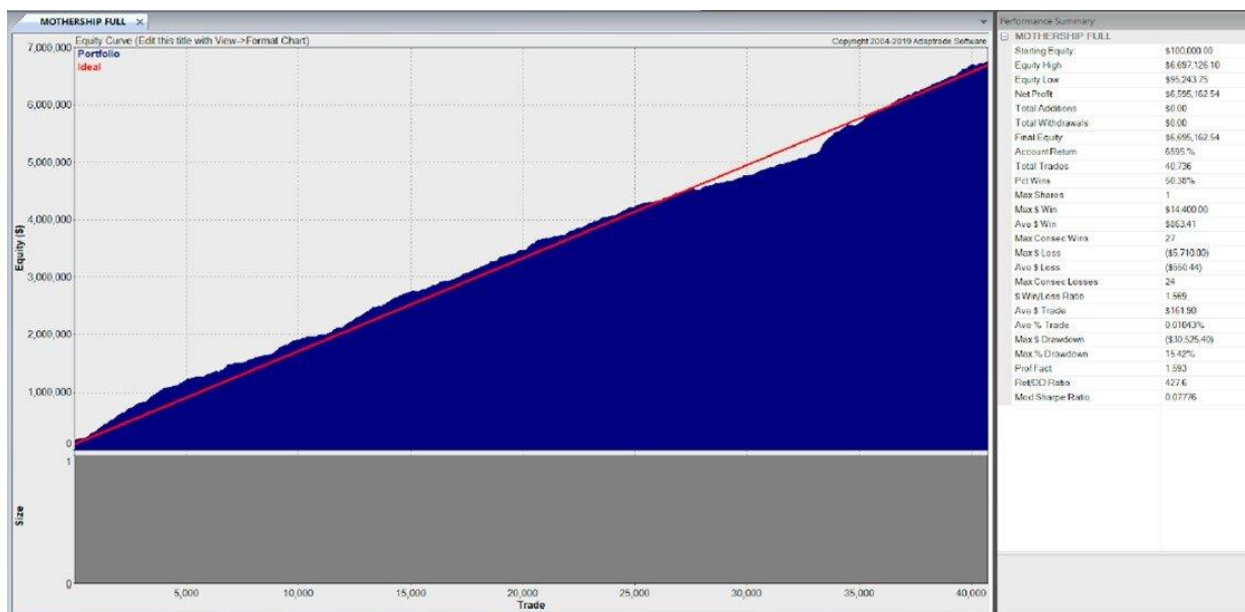


Кривая капитала
Капитал (\$)
Количество сделок

ES Glider – это стратегия свинг-трейдинга, созданная для совершения только длинных сделок. Она имеет фиксированные в долларах ордера стоп-лосс и тейк-профит и является очень старой стратегией.

Не могли бы вы поделиться дополнительными показателями/информацией о вашем текущем портфеле?

Мой текущий портфель публично отслеживается на веб-сайте Striker, и он называется "Mothership". Тем не менее, для каждой стратегии используется только 1 контракт. Сверху я запускаю наложение размеров позиции, но график даёт разумное представление о производительности. Основная идея, лежащая в основе его – это то, чему меня научил Томас: определение размера системы. Чем больше стратегий вы объедините, тем более плавным будет ваш результат торговли. Вот проверенная картина:



Вы прошли через множество психологических переживаний. Что вы узнали о психологии торговли на сегодняшний день? Что узнали о себе? Считаете ли вы, что ваш торговый путь каким-либо образом изменил вас?

Торговая психология – это самая сложная часть торговли. И я ещё не освоил её до конца. В моей традиционной работе в качестве пожарного я был подвержен некоторым очень мучительным переживаниям за последние несколько лет, и это сказалось на мне психологически. На пике этих переживаний трейдинг был скорее побегом, чем бременем. Сейчас, когда я нахожусь в мире с этим опытом, я понимаю, что для регулирования торговой психологии могу применять те же методы, которые используются для борьбы с посттравматическим стрессовым расстройством.

Прежде всего, это медитация и осознанность, но также заслуживают внимания и многие другие. Я занимался дыхательными упражнениями и проводил около половины своих часов бодрствования в океане, что помогает регулировать настроение, но я определенно нахожусь в зачаточном состоянии освоения отключения мозга/торгового счёта. Недавно я установил себе правило: я проверяю свой торговый счёт только один раз в день, если нет особых причин для более частой его проверки.

Допустим, начинающий трейдер читает это интервью. Он без ума от формулы Мистера Пробои и алгоритмического трейдинга, хочет избежать как можно больше ошибок и сделать свой рост в трейдинге как можно более плавным. Что бы вы посоветовали такому трейдеру? Как они должны начинать? Какие рынки и направления им следует выбирать и сколько торговых стратегий использовать? На каких трёх самых важных вещах им следует сосредоточиться?

Подумайте о микро- и мини-фьючерсных контрактах. В настоящее время они доступны, и их широко рекомендуют – это поможет сделать ваш первый портфель очень достижимым и простым в торговле. Три года назад, когда я начинал, никто не рекомендовал микропортфели. Так что, если бывшие студенты могли торговать только на полных контрактах, микро-фьючерсные контракты должны быть вашим лакомым куском!

Далее будьте практичны. Когда мы пытаемся научиться торговать, на ум приходят термины «сброс данных» и «информационный перегруз». Объём информации в трейдинге безумный, и успешный трейдинг включает в себя слияние около 100 различных навыков. Итак, если вы торгуете, чтобы заработать деньги, вам нужно расставить приоритеты. Каждый раз, когда вам предлагают новейшие горячие исследования, вы должны задаться вопросом: «Как я могу практически применить их к моей личной торговле?» Если это выше вашего уровня навыков

или не имеет для вас значения, то двигайтесь дальше. Если же вы видите, что это добавит ценности и это то, что вы можете реализовать практически, излишне не задерживаясь на нём, то продолжайте двигаться вместе с этой информацией. Старайтесь не спускаться в кроличьи норы. Дорога сплошь и рядом усеяна ими.

Отвечая на другие вопросы, должен сказать, что, на мой взгляд, портфеля микро-фьючерсных контрактов на более простые в разработке активы должно быть достаточно, чтобы вы встали на свой путь. Внутрдневная торговля золотом и сырой нефтью, стратегия свинг-трейдинга на соевых бобах, стратегия NASDAQ для торговли на микроконтрактах (в начале вашей карьеры в трейдинге рассматривайте NQ как менеджер окон) и, возможно, стратегия свинг-трейдинга на японской йене – все они имеют микроконтракты и помогут вам встать на верный путь. Как только вы набьёте на них руку, вы можете начать фокусироваться на более экзотических рынках.



Переведено для трейдинг портала Tlap.com