

## Раздел 1-психология трейдера (обзор)

Я-послушник покойного Марка Дугласа. Многие из моих убеждений в отношении трейдинга непримиримо заимствованы из его учения.

Я считаю, что успех или неудача трейдера в значительной степени обусловлены его психологией. Очевидным фактом является то, что стратегия с ребром необходима, но это ребро не приведет к равномерной отдаче, как только вы вовлекаете человека в процесс принятия решений.

Я принимаю риск, присущий торговле. Я также принимаю тот факт, что у меня будут убыточные сделки. Я буду терять дни, а может быть, и недели. Каждая сделка не имеет отношения к моей общей методологии и воспринимаемому преимуществу. Распределение выигрышей и проигрышей будет случайным образом распределено в пределах моего общего показателя успеха. Я не ожидаю, что моя следующая сделка будет выигрышной. Моя следующая сделка не зависит от предыдущей.

По этим причинам я не испытываю эмоциональной привязанности к какой-либо отдельной сделке, которую я делаю.

Я признаю неопределенность, как в жизни, так и в торговле. Я признаю, что все может случиться, и что я не знаю, что произойдет. Я торгую, основываясь на том, что вижу, и реагирую на то, что происходит на моих графиках. Я не хочу и не нуждаюсь в успехе в каждой сделке. Я не жажду определенности посредством анализа. Мой анализ просто рассматривает вероятности.

Я не поддаюсь тому, что Марк Дуглас называет четырьмя основными торговыми страхами.

Мне комфортно терять деньги.

Мне удобно ошибаться.

Мне удобно оставлять деньги на столе.

Мне удобно упускать такую возможность.

Я отношусь к своей торговой карьере с тем же профессионализмом, что и к своей предыдущей карьере. Я готов потратить часы экранного времени, необходимые для поиска возможностей. Я готов потратить часы личного развития и самосовершенствования, необходимые для дополнения моей торговой методологии. Я просматриваю свои сделки ежедневно. Цель этого состоит в том, чтобы проанализировать мои входы, мои выходы и то, является ли мой предполагаемый край все еще очевидным над подходящим размером

выборки.

## **Раздел 2-Управление торговлей (обзор)**

Я активно управляю своими сделками, пытаюсь извлечь из них максимальную выгоду. Инструменты в моем распоряжении самые разные. В этом разделе излагаются различные методы, которые я применяю.

Во-первых, у меня всегда есть остановка на рынке. Торговля без остановки неоптимальна, и я отказываюсь это делать. Однако, поскольку я заранее не знаю, куда рынок должен будет пойти, чтобы доказать мою неправоту, мой стоп принимает форму катастрофической остановки. То есть стоп находится достаточно далеко от ценового действия, чтобы избежать прерывания моей торговли, пока настройка все еще действительна. Остановка действует как ресурс в случае непредвиденной чрезвычайной ситуации. Мои стопы почти никогда не попадают, но они обеспечивают мне уровень безопасности, если я не смогу управлять торговлей вручную.

Во-вторых, я торгую небольшим размером позиции относительно размера моего счета. Я рискую менее чем 1% за сделку. Поскольку каждая сделка имеет случайный исход, мой размер позволяет мне подходить к каждой сделке с уверенностью, что мой торговый счет не будет существенно затронут убытком. Я считаю, что размер позиции относительно размера счета является ключевым фактором успеха или неудачи в торговле. Я не ожидаю, что отдельная сделка станет победителем, и мое управление размером защищает меня от любой отдельной сделки, оказывающей пагубное влияние на мой торговый счет в любой значительной степени.

В моем распоряжении есть два типа записей. Вход одной пули и вход нескольких пуль. Я всегда заранее решаю, какой тип техники входа я собираюсь применить к сделке, и соответственно определяю размер своей позиции.

Вход с несколькими пулями включает в себя разделение моего торгового размера на 3 сегмента. Целью стратегии является достижение смешанной цены. Это очень отличается от неоптимальной техники "прибавления к проигравшим". Я бы никогда не рекомендовал принимать решение о добавлении к позиции, когда вы уже находитесь в сделке. Это следует планировать заранее.

Я выхожу из позиции с убытком, когда рынок говорит мне, что я неправ. Вот почему 99,8% моих выходов являются ручными. Я никогда не сижу и не жду, когда появится стоп-лосс. Я никогда не сижу и не надеюсь, что положение изменится, как только будет доказано, что я ошибаюсь.

Я выхожу из позиции с прибылью одним из двух способов. Я либо снимаю всю

позицию, либо получаю частичную прибыль. Обычно это половина моей позиции, хотя иногда я снимаю свою позицию в 3 сегментах.

Мой предпочтительный метод выхода-фиксировать частичную прибыль в логической точке графика. Моя методология выделяет эти логические точки в виде максимума или минимума предыдущего дня, максимума или минимума ADR, дневной открытой линии или простой скользящей средней линии. Я предпочитаю брать частичную прибыль, так как знаю, что позиция может превратиться в "бегуна", который намного превышает логическую точку выхода. Торговля таким образом означает, что у меня есть либо половина, либо одна треть моей позиции все еще в игре, чтобы захватить большие ходы.

В дополнение к этому я иногда использую глобального торгового менеджера, чтобы автоматически закрыть все открытые позиции, как только будет достигнут определенный процент прибыли, сопоставимый со стоимостью моего счета. Это особенно полезно во времена или на рынках с высокой волатильностью, поскольку глобальный торговый менеджер может реагировать быстрее, чем я, чтобы закрыть позиции.

Моя методология действительно позволяет заранее размещать записи тейк-профита, но стоп-лосс не может быть определен заранее, поэтому используется аварийный стоп.

### **Раздел 3-Виды торговли (обзор)**

Я торгую общей методологией, которую называю дорожной картой. В моем распоряжении имеются различные виды торговли. Существуют две основные стратегии:

1. Пересечение канала-Когда канал ЕМА полностью переходит на другую сторону SMA.
2. Сбой канала-Когда канал ЕМА частично пересекает SMA, но затем возвращается на предыдущую сторону.

К четырем передовым стратегиям относятся:

1. Отказы ADR - когда канал ЕМА частично пересекает линию ADR, но затем возвращается в предыдущую сторону.
2. Провалы максимума/минимума предыдущего дня - когда канал ЕМА частично пересекает линию максимума / минимума, но затем возвращается в предыдущую сторону.

3. Счетчики ADR-когда инструмент завершил средний дневной диапазон, я рассматриваю возможность входа, чтобы зафиксировать возврат к центральной земле.

4. Счетчики High/Low предыдущего дня - когда инструмент достиг максимума или минимума предыдущего торгового дня, я рассматриваю вход для захвата разворота.

Решения о том, стоит ли использовать торговую возможность или нет, в основном основаны на моем анализе структуры графика. Я также использую приборную панель CompositeRSI и SMA.

## **Раздел 4-Управление Торговлей (Пример)**

Шаг 1: Установите процент теоретического риска на сделку. (В этом примере мы будем использовать 1%).

Шаг 2: Определите, где будет происходить аварийная остановка в любой сделке.

(Для целей данного примера предполагается, что EURUSD stop равен 50 пипсам, а GBPUSD stop-100 пипсам).

\*Обратите внимание, что ваша аварийная остановка не будет срабатывать в большинстве случаев, если торговля активно управляется. Это просто позволяет торговле дышать до тех пор, пока рынок не докажет ее ошибочность\*

Шаг 3: вычислите размер позиции. В этом примере риск 1% от счета в 10 000 долларов будет равен риску в 100 долларов.

EURUSD (стандартный лот = \$10/pip) позволит **торговать позицией 0,2 лота** при аварийной остановке на 50 пунктов

GBPUSD (стандартный лот = \$10/pip) позволит **торговать позицией 0.1 лота** при аварийной остановке 100 пунктов

Поскольку фактический риск для каждой сделки будет намного меньше теоретического риска, который обеспечивает аварийная остановка, полезно думать в терминах коэффициента прибыли.

Это рассчитывается просто путем деления валовой прибыли на валовые убытки. Если валовая прибыль составляет 50 000, а валовой убыток-10 000, наш

коэффициент прибыли будет равен 5.

Использование этого расчета позволяет анализировать завершённые сделки в подходящих размерах выборки, чтобы помочь определить настоящее преимущество.

## **Раздел 5-для трейдеров индексов 1м / нефть**

Торговля этими инструментами на таймфрейме 1m должна рассматриваться как отличная от сделок на более высоком таймфрейме. Исходное смещение CompRSI основано на 4-х часовых, дневных и недельных таймфреймах. Очевидно, что это не так важно для трейдера Dow 1m.

По этой причине не следует придерживаться стандартного смещения RSI. Вместо этого существует способ использования CompRSISelectv2 (доступный в посте 1 моей темы дорожной карты), который может оказаться полезным для таких трейдеров.

Настройки индикатора составляют 15/60/0/0, а линии следует добавлять на 55 и 45. Выше 55-это бычье направление, ниже 45-медвежье.

Пожалуйста, обратите внимание, что это все еще находится в экспериментальной стадии и может измениться в зависимости от тестирования. Однако я надеюсь, что он послужит руководством к более краткосрочному импульсу.

Ниже я приложил пример диаграммы.



## **Раздел 6-входы (в отношении канала)**

Я думаю, что необходимо дать некоторые разъяснения по моим руководящим принципам, а также по решениям, которые должен принимать трейдер.

Я начал поток, посоветовав, что для длинных входов точка входа должна быть на нижней стороне канала. И наоборот, короткие входы должны быть в верхней части канала. Это всегда было задумано как временное упражнение в дисциплине. Позже я смягчил этот совет, заявив, что входы могут происходить **внутри** канал.

С запросом Ганновера я снова изучил критерии входа и пришел к выводу, что мой совет остается прежним. Я предпочитаю не гнаться за ценой вверх по внешней стороне канала, и поэтому предпочитаю найти вход внутри него.

Однако трейдеры должны взять на себя ответственность за свои собственные критерии, даже если они следуют моей методологии. Точка зрения Ганновера о входах за пределы канала имеет свои достоинства. Это правда, что многие восходящие тренды начинаются со свечи, закрывающейся выше канала. Если визуальный бэктест приводит к выводу, что это должно быть триггером входа, обязательно действуйте на этой основе. Мне, конечно, интересно услышать другие выводы, основанные на тестировании/опыте (в моей основной теме, пожалуйста, не здесь).

Если кто-то ничего не знает о том, что я говорю, я представлю две диаграммы.

Входим внутрь канала:



Вход за пределы канала:



## Раздел 7-Трендовые Линии

Хотя здесь будет присутствовать элемент повторения, я хочу привести здесь дополнительные примеры, чтобы они были легко доступны. Как уже говорилось в другой теме, я не придерживаюсь традиционных "правил" линий тренда. Это просто прямые линии, которые помогают определить импульс и структуру. Использование линий тренда поможет как входам, так и выходам.

На первом графике ниже, скажем, я прибыл на свой экран примерно в то время, когда цена была в оранжевом поле. Канал был выше СМА, должен ли я войти?

Проведя две простые линии, я получаю ответ. Красная линия тренда говорит мне, что был сформирован более высокий минимум, а синяя линия тренда говорит мне, что медвежий импульс, вероятно, был погашен.



Так что сейчас у меня длинная сделка, и я хочу взять немного прибыли со стола, чтобы позволить остальным работать. Как линии тренда могут помочь мне сделать это? Как показано ниже, добавив коричневую линию тренда к двум недавним максимумам, я теперь имею потенциальные зоны тейк-профита на уровне 1 или 2



Итак, у меня есть небольшая прибыль в кармане. Теперь я хочу позволить остальным работать некоторое время, но я также хотел бы добавить, если это возможно, когда цена пойдет в мою пользу. Как линии тренда могут помочь мне сделать это?



Рисуя пурпурные линии коррекции выше, я могу определить потенциальные зоны добавления на 3,4 или 5.

Теперь предположим, что цена поднялась выше точки 5, и я чувствую себя очень счастливым. Но когда мне следует подумать о том, чтобы выбраться отсюда? Опять же, линии тренда могут помочь.

Первоначально я мог бы нарисовать оранжевую линию тренда, как показано ниже, присоединившись к недавним минимумам. Однако это явно отдаст слишком большую часть моей прибыли, ожидая, пока она будет сломана. Затем я рисую линию скорости зеленым цветом. Это предупредит меня о снижении ценового ускорения.



Когда линия скорости сломана, я выхожу (вокруг 2-го оранжевого квадрата). Это оказывается хорошим решением, поскольку цена падает, а затем катится боком.

Давайте сделаем приблизительный расчет прибыли. Начальная часть сделки вернулась примерно на 40 пунктов, когда я зафиксировал прибыль в точке 1. Оставшаяся часть этой сделки вернулась примерно на 160 пунктов, когда я вышел из нее после того, как моя скоростная линия была сломана. Давайте будем консервативны и скажем, что я только добавил к своей позиции, когда линия отката на 5 была пробита. Это еще 60 баллов.

Итак, разброс по 3 позициям, у меня общая прибыль составляет 260 пунктов. И все это благодаря простому использованию линий тренда для информирования моих решений о входах и выходах.

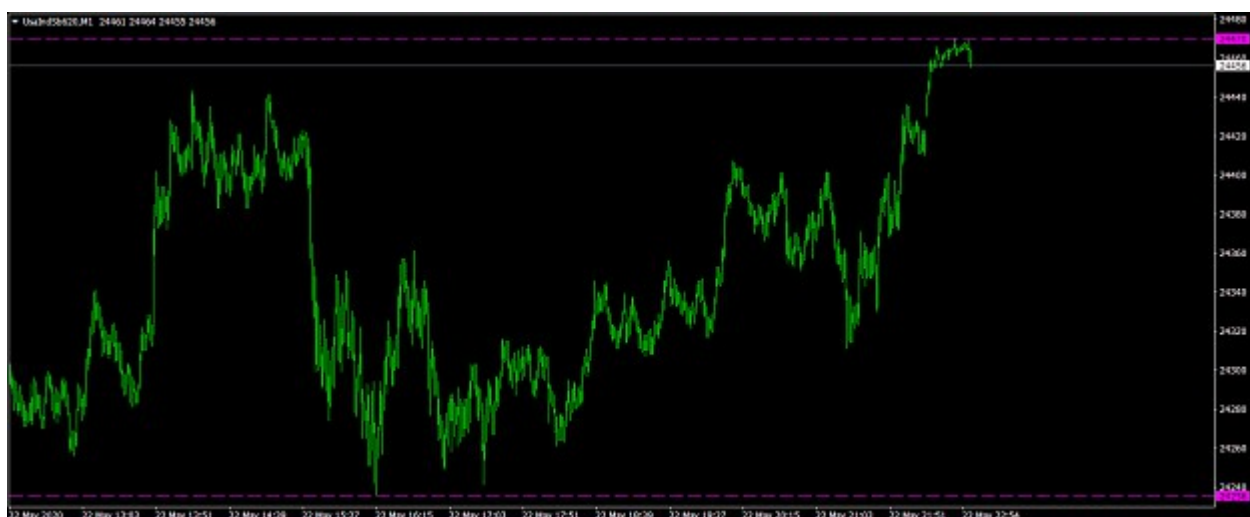
## Раздел 8-Посмотрите Налево

Я старался выпускать информацию постепенно, и с разговорами в основном потоке о "взгляде налево", я думаю, что пришло время ввести еще один элемент анализа. Это в дополнение к трендовым линиям, которые сами по себе должны побуждать вас "смотреть влево".

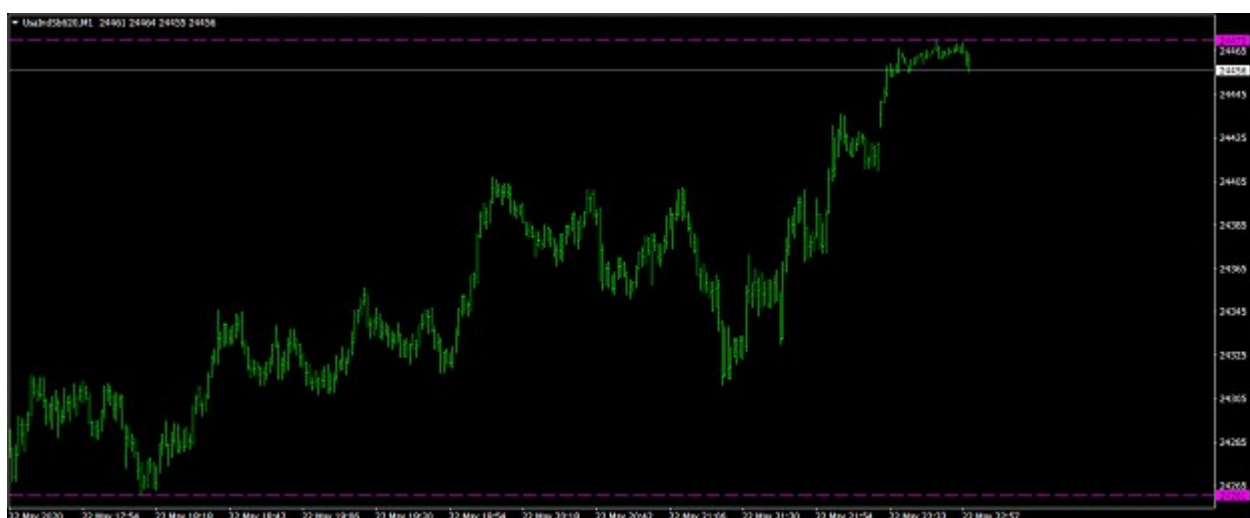
Начните с выбора желаемого таймфрейма. Уменьшите масштаб, насколько это позволяет ваша платформа. Затем вручную добавьте горизонтальные линии на непроверенных максимумах и минимумах следующим образом:



Теперь увеличьте изображение один раз и повторите то же самое.  
 Непроверенные максимумы и минимумы с вашей текущей точки зрения:



Увеличьте изображение еще раз и повторите то же самое



Теперь уменьшите масштаб полностью:



Теперь нарисуйте непрерывные линии тренда:



Теперь у вас есть размеченная диаграмма, вы можете увеличивать масштаб по мере необходимости и анализировать в обычном режиме.

Это только царапает поверхность осознания поддержки и сопротивления, но это хорошая отправная точка для того, чтобы привыкнуть осознавать то, что исторически происходило на графике.