

Михаил Тарасов

Системная торговля на рынке акций.

2016

Тарасов М.
Системная торговля на рынке акций
Редактор: Ростислав Зайков

Михаил Тарасов © 2016
Nakladatelství „Olga Krylova“ © 2016

В книге изложен системный подход при торговле на рынке акций.

– Описанная “Система торговли” полезна профессионалам, которым необходимо расширить свои знания и усовершенствовать свою торговлю.

– Знания, которые вы почерпнете из этой книги, улучшат ваши показатели как трейдера, если вы среднестатистический начинающий инвестор.

– Если вы новичок, книга поможет вам избежать потерь вашего инвестиционного капитала.

Оглавление

Предисловие.....	5
Глава 1. Биржа и голодные брокеры.....	6
Глава 2. Налоговая нагрузка.....	15
Глава 3. Распределение средств.....	16
Глава 4. Между жизнью и смертью депозита.....	21
Глава 5. Неоценимые заслуги.....	24
Глава 6. Горизонт инвестирования для счета. Течение одной сделки во времени.....	28
Глава 7. SHORT and LONG.....	32
Глава 8. Страхи трейдера. Рыночное равновесие.....	34
Глава 9. Высокоточные сигналы на вход в рынок. Методика распознавания.....	38
Глава 10. Как «отжать» брокера или серфинг счетов.....	49
Глава 11. «Боллинджер» как вспомогательная часть системы.....	75
Глава 12. Накопление силы сигнала на «Лонг» и «Шорт».....	78
Глава 13. Сложение силы сигнала внутри дня.....	87
Глава 14. Мечел, хороший наглядный пример для изучения теории.....	88
Глава 15. Работа системы «Шаблон».....	92
Глава 16. «Секреты управляющего».....	95
Глава 17. Позиционная торговля.....	97
Глава 18. Позиционность в торговле и причины возникновения.....	107
Заключение.....	110

Предисловие

Книга написана профессиональным трейдером, который начал торговать на российском рынке акций со дня его основания.

Книга - обобщение накопленных знаний, итогом которых стало создание “Системы Шаблон”.

Материал, находящийся в книге требует тщательного внимания и изучения, прежде чем может быть использован.

В-первую очередь “Система Шаблон” будет интересна читателям имеющим многолетний опыт работы на биржевых площадках по профилю своей профессиональной деятельности.

Обычных частных инвесторов и начинающих трейдеров книга, безусловно, уберезёт от потерь собственного депозита.

Внимание: Если после прочтения материалов, изложенных в книге у вас возникают множественные вопросы, вам лучше воздержаться от торговли на рынке акции, инвестирования и трейдинга.

Глава 1

Биржа и голодные брокеры

Сразу отметим, что все мои лекции запрещены ведущими брокерами страны за анти-брокерскую риторику.

Как все мы знаем, деньги не печатают на бирже. Их туда приносят такие же как мы, трейдеры. Чтобы на российской бирже легко жилось всем участникам торгов, а частники, открывая новые брокерские счета, могли в полной мере насладиться бесконечными потоками прибыли, которые непременно потекут широкой рекой на их именные депозиты, не хватает маленького нюанса. А именно – официально зарегистрированного печатного станка, который бы эти деньги печатал и выдавал всем согласно отправленным биржевым заявкам. Поэтому, пока этого не произошло, любая система с высокой доходностью «Я – против всех», заранее обречена на провал.

Что мы имеем сегодня. Сегодня первый, кто стоит между нами и прибылью, - это сама биржа под кодовым названием ММВБ. Это первая структура, которая соберет с нас 0,01% от каждой нашей сделки. Много это или мало, мы обсуждать не будем, мы отдельно это посчитаем в одной из глав нашей книги. Пусть это будет первая глава, чтобы начать формирование нашей системы с первых страниц книги.

Итак, для того, чтобы не заниматься расчетами дважды, сразу всех предупредим, биржа - это еще мелкий карманник по сравнению с брокером, у которого вы откроете счет для торговли акциями.

Брокер обозначит свои интересы никак не меньше 0,03% за операцию и будет позиционировать этот тариф как тариф для интенсивной торговли, что в сумме с аппетитом биржи составит 0,04% за операцию.

Итак, начнем расчеты. Вы - хороший российский гражданин среднего класса. Вы трудились добросовестно и смогли отложить деньги, которые обозвали начальным капиталом и на которых вы

непрерывно зарабатываете прибыль, используя эти средства как инвестиции на российском рынке акций.

Безусловно, как человек грамотный, вы знаете, что нужно инвестировать в компании с государственным участием, чтобы избежать резкого падения курса акций. Вы в кратчайшие сроки нашли брокера из первой пятерки самого надежного рейтинга, открыли у него счет и внесли для ровного счета один миллион рублей. Много? Хорошо, пусть это будет 500 тысяч рублей, ведь вы впервые пришли на биржу, не нужно туда нести свои сбережения сразу.

Как человек грамотный вы понимаете, что нужно совершать сделки, чтобы заработать прибыль. Вы также понимаете, что сделка, дающая прибыль, будет называться прибыльной сделкой. Чем больше прибыльных сделок, тем больше доходность вашего инвестирования. Мы не будем сейчас обсуждать, какое количество прибыльных сделок вы совершите, а какое количество будет из них убыточным. Мы пока просто поговорим о сделках в чистом виде.

Итак, одна сделка - это покупка, которая состоит из комиссии 0,01% (биржа) и 0,03% (брокер), итак, вы совершили вход в рынок, и у вас появились на счету акции, за это вы отдали брокеру и бирже 0,04% от своего депозита. Чтобы закрыть сделку, вы должны закрыть позицию. Именно после закрытия позиции вы увидите на своем счете прибыль или убыток. Но, как только вы захотите закрыть сделку, вы отдаете еще 0,04%. Итак, мы видим, что, совершив одну сделку "вход + выход", мы платим брокеру 0,08%.

Пока не будем принимать в расчет, заработали мы на этой сделке или потеряли, пока будем просто считать, сколько мы платим организациям, которые нас «обслуживают». С учетом того, что тариф 0,03% брокер позиционирует как комиссию для активной торговли, то, чтобы его получить, нужно оговорить в договоре условие, что дневной оборот не может быть меньше пяти миллионов рублей. Соответственно, чтобы удержать тариф, нам нужно обернуть наши 500 тыс. рублей десять раз за день или совершить пять закрытых сделок. Купить акции, продать акции, сделать эту процедуру пять раз.

Как мы уже знаем, если одна сделка - это 0,08% от нашего депозита, то пять будет 0,4%.

Что мы видим? Скромные 0,04% от оборота превращаются в 0,4% от депозита за один торговый день. Если мы будем торговать 25 рабочих дней в месяц, то будем платить брокеру и бирже $25 * 0,4\% = 10\%$. Мы будем платить «обслуживающим» нас организациям 10% в месяц от суммы открытого нами счета или 120% годовых. Т.е., если мы будем совершать сделки безубыточные, но ничего не сможем на них заработать, мы отдадим брокеру все наши деньги за десять месяцев.

Что нам может предложить брокер взамен? Какие он предлагает нам варианты, чтобы как можно быстрее «обогатиться»? Мы, конечно, забыли о кредитном плече, которое предоставит нам наш любимый брокер, а именно - возможность использовать внутри дня бесплатно кредитные деньги самого брокера. Как правило, по умолчанию на ваш счет установят кредитное плечо 1 к 3. Т.е., имея наши 500 тыс. рублей на счету, мы сможем за раз покупать на 1,5 млн. рублей акций, что, как заверит нас наш брокер, ускорит получение нами прибыли.

Продолжим расчеты. Наш оборот увеличился в три раза. Соответственно мы платим брокеру уже не 10% в месяц, а 30%. Это говорит о том, что мы устанавливаем брокерскую нагрузку на наш депозит в размере 360% годовых. Как мы теперь понимаем, нам нужно начинать строить свою систему с расчетом на то, чтобы она давала доходность с первого дня нашей торговли выше, чем 360% годовых, чтобы мы могли кормить брокера. Все, что выше, будет наше. А у каждого ли приходящего на биржу есть система, позволяющая заработать на акциях больше, чем 360% годовых? Конечно же нет. Поэтому именно деньги каждого и уйдут брокеру и бирже на восполнение прописанных в договоре условий по комиссиям и сборам. А нам останется подумать, где взять деньги на следующий депозит.

В книге есть приложения. Статьи «Адская арифметика» и «Адская мясорубка». Их нужно прочесть, они с расчетами. После прочтения перейдем к выводам, которые нас ждут после прочтения первой главы.

Адская арифметика или свет в конце туннеля.

Все слышаны о распространенных услугах различных брокерских компаний по типу «Тариф с сопровождением», т.е. Вас позиционируют как ВИП-Клиента и включают в Ваш тариф «услуги консультанта, высокоточные сигналы, различные экспорт – пакеты». Как правило, такая услуга стоит 0,08% от сделки.

Т.е. ситуация простая. Вы вкладываете деньги и тут же начинаете платить проценты с каждой сделки. И считаете, что Вам как ВИП-КЛИЕНТУ дадут заработать.

Остановимся на этом моменте подробнее применяя легкую магию чисел.

Вариант №1.

Услуги эксперта настолько хороши, что вы совершаете 5 сделок на депозит в день.

1. Вход/выход = сделка = 0,16%
2. Пять сделок равно 0,8%
3. 250 дней покупаете эту услугу в год = 200% годовых.

Вывод: вы купили услугу не за жалкие 0,08% с оборота, а за 200% годовых.

Вариант №2

Вы делаете 10 сделок и используете 1 плечо.

В этом случае 10 сделок - это уже 1,6%, 250 дней умножаем на 1,6% = 400%, используя 1 плечо, вы получаете «Услугу» с большой буквы за 800% годовых.

Теперь приведу простой пример для стандартного Тарифа среднестатистического брокера, а Вы сами решите, есть ли у Вас шанс на этом поле боя, и как его использовать.

Тариф 0,025% (Следует отметить, что на сегодняшний день такие тарифы считаются Интенсивными, и вам необходимо совершить сделки в диапазоне от 1 млн. руб. до 5 млн. руб., чтобы указанный тариф Вам предоставили, а это в среднем 10 сделок в день на приличном депозите).

1. Вы торгуете очень Хорошо, у вас 10 сделок
 $= 0,025 * 2 * 10 = 0,5\%$

Т.е. Вы платите с вход/выход и так 10 раз. Вы должны зарабатывать больше, чем полпроцента в день, так как Вы вложили деньги в Биржу и начинаете платить 125% годовых сразу.

Очень «хороший вклад», я вам скажу, изначально деньги вложены под МИНУС 125% годовых. Но постойте, Вы же хороший трейдер... поэтому вы используете одно плечо, а это уже 250% годовых на депо. Тогда 3 плеча - 375% годовых... 4 плеча... 500% годовых!

Господа трейдеры, прежде чем делать вклад в свое будущее, подумайте, осилите ли Вы ношу в минус 500% годовых по такому вкладу?

Есть ли у Вас стратегия, дающая больше денег?

если нет, то... для указанного тарифа 0,025%

1. Скажите нет плечам. Тогда вы заплатите за Услугу 125%.
2. Скажите нет десяти сделкам, есть только одна сделка, тогда это 12,5% годовых нагрузки.

*Остается лишь выбить указанный тариф на таких условиях, ведь ни о каких 5 млн. рублей оборота в день речь уже не идет.

Пусть каждый возьмет свои плечи, вставит свое количество сделок, возьмет свой тариф и рассчитает, какую услугу он купил у брокера.

Есть у лидеров брокерского рынка и совсем ВИП-ТАРИФЫ. Это 0,3% и вам гарантируют ВИП-УСЛУГУ и ВИП-СОПРОВОЖДЕНИЕ. Представляю, как какая-нибудь «фифа» с рублевки или сыночек-чиновника хвастаются перед своими тупыми друзьями в пафосном ночном клубе:

«У меня ВИП-ТАРИФ у «такого-то» брокера, Я – Трейдер!»

Ну, так чем же он похвастался?!

Тариф: ВИП-ТАРИФ 0,3%

1. Одна сделка - это 0,6%
2. Одно плечо 1,2%.
3. 250 дней торгует по ВИП-СОВЕТАМ и платит 300% годовых.

Дальше нет смысла вести расчеты, он попался в ВИП-ЛОВУШКУ и будет сам себя винить за слитые ВИП – Миллионы. Совершая три сделки в день и платя брокеру 900% годовых за

услугу, он для того, чтобы заработать, должен торговать с эффективностью свыше 1000%.

- На заметку. В сделке две стороны, и те 800% которые платите Вы, платит такой же умник с другой стороны, поэтому брокеру достается вообще 1600%.

- Если и покупать такую услугу как ВИП-ЭКСПЕРТ (если она вообще вам необходима), то нужно купить ее по самому маленькому депозиту, а уж если рекомендации так хороши, то повторяйте их на соседнем счете БЕСПЛАТНО.

Перейдите к вложению «Сравнительная таблица тарифов»

Вставьте в расчет ваш тариф и вашу интенсивность сделок в день, укажите свое кредитное плечо и вы получите брокерскую нагрузку на ваш депозит, которая исчисляется в годовом проценте.

Пример использования:

1. С тарифом 0,01% с оборота при первом плече и пяти сделках в день брокерская нагрузка на Ваш депозит равна 50% годовых. Т.е. с 1 миллиона рублей при такой интенсивности операций, Вы только брокеру за год отдадите 500 тыс. рублей. Да и то только в том случае, если будете торговать в плюс. Но чаще всего с каждым днем Ваш депозит будет сокращаться и брокерская нагрузка, процент которой неизменен, при одинаковой интенсивности операций будет распределяться на сумму, которая будет становиться меньше с каждым днем.

Вывод: Вам необходимо либо сократить количество операций, либо иметь стратегию, дающую намного больше 50% годовых.

2. С тарифом 0,03%, трех плечах и 10 сделках в день брокерская нагрузка на ваш депозит равна 600% годовых, т.е. равна шести Вашим депозитам.

Есть ли у вас стратегия, которая позволит Вам заработать 600%, чтобы отдать их брокеру?! Если нет, то вам необходимо от-казаться от такой интенсивности сделок при таком тарифе.

3. С тарифом 0,03%, одним плече и 5 сделках в день брокерская нагрузка на ваш депозит равна 150% годовых. Это в полтора раза больше, чем ваш депозит, и вы должны понимать, что вам нужна стратегия, которая будет давать значительно больше, чем 150% в год.

У вас есть такая стратегия?! Вы такой умный и везучий трейдер?!

Вам просто нужно либо сменить тариф, либо сменить брокера, либо сменить профессию, так как Вы не трейдер. Ни один нормальный и успешный трейдер не станет отдавать брокеру 150% в год со своего депозита, это изначально кабанья сделка, она погубит ваш депозит и приведет к полному исчезновению денежных средств с него.

При использовании указанного тарифа у вас есть только один шанс выжить: это не более 2 сделок в день без кредитного плеча. Тогда брокерская нагрузка на ваш депозит, которая исчисляется в годовом проценте, будет 30%. Т.е. эти 30% с Вас брокер все равно ЗАБЕРЕТ, и это только брокер, без биржевой комиссии и прочих сборов, соответственно вам нужна стратегия, дающая намного больше чем 30%.

Также вы должны понимать: чтобы МНОГО заработать, чтобы получить эти самые пресловутые сотни процентов, нужно СОВЕРШАТЬ СДЕЛКИ. Как правило, одной или двумя сделками в месяц сыт не будешь. Если вы Активный трейдер, то вы должны совершать большое количество сделок в день и на весь депозит, НО - ЗАГЛЯНИТЕ В ТАБЛИЦУ, посмотрите, КАК в геометрической прогрессии увеличивается брокерская нагрузка, исчисляемая в годовом проценте на ваш депозит.

Т.е. вы загнаны в угол, вы не сможете заработать много, не совершая много сделок, а совершая много сделок, многократно вырастает брокерская нагрузка на ваш депозит и либо вы выбиваете ФИКС ТАРИФ у брокера, либо вы сливаете СВОЙ ДЕПОЗИТ.

Это простая математика, и если вы не понимаете этих расчетов, то вы жертва.

Спасти можно только одним способом, НЕТ ФИКС ТАРИФА, значит не активной торговли. Просто прекращайте количество ваших операций, уходите либо в среднесрочное инвестирование,

либо в долгосрочное, ни интрадей ни тем более скальпинг – ДЛЯ ВАС НЕ ВОЗМОЖЕН.

Загляните еще раз в сравнительную таблицу тарифов брокеров и подставьте ваше плечо и вашу интенсивность операций / количество совершаемых сделок в день. Подставьте туда количество сессий, которые вы торгуете, запишите Значение Брокерской нагрузки на ваш депозит и держите ЭТО ЧИСЛО перед своими глазами всегда. Это знание даст понять, что у вас просто нет стратегии, которая могла бы накормить вашего ненасытного брокера, дать ему сначала 300-750% годовых в лучшем случае, а объедки отдать вам как подачку.

Удачи в торгах с тарифом Выше 0,01% от оборота! Вы смертники господ, вы смертники Брокерской Биржи!

Сравнительная таблица тарифов							
Тариф брокера	Вход/выход	Плечи*	С плечом	Кол-во сделок	С учетом количества сделок	Количество торговых сессий	Нагрузка на депозит/В процентах (% в год)
0,01	0,02	1	0,02	1	0,02	250	5
0,01	0,02	1	0,02	2	0,04	250	10
0,01	0,02	2	0,04	5	0,2	250	30
0,01	0,02	2	0,04	7	0,28	250	35
0,01	0,02	4	0,08	10	0,8	250	200
0,01	0,02	4	0,08	15	1,2	250	300
0,025	0,05	1	0,05	1	0,05	250	12,5
0,025	0,05	1	0,05	2	0,1	250	25
0,025	0,05	2	0,1	5	0,5	250	125
0,025	0,05	2	0,1	7	0,7	250	175
0,025	0,05	4	0,2	10	2	250	500
0,025	0,05	4	0,2	15	3	250	750
0,03	0,06	1	0,06	1	0,06	250	15
0,03	0,06	1	0,06	2	0,12	250	30
0,03	0,06	2	0,12	5	0,6	250	150
0,03	0,06	2	0,12	7	0,84	250	210
0,03	0,06	4	0,24	10	2,4	250	600
0,03	0,06	4	0,24	15	3,6	250	900
0,08	0,16	1	0,16	1	0,16	250	40
0,08	0,16	1	0,16	2	0,32	250	80
0,08	0,16	2	0,32	5	1,6	250	400
0,08	0,16	2	0,32	7	2,24	250	560
0,08	0,16	4	0,64	10	6,4	250	1600
0,08	0,16	4	0,64	15	9,6	250	2400
0,3	0,6	1	0,6	1	0,6	250	150
0,3	0,6	1	0,6	2	1,2	250	300
0,3	0,6	2	1,2	5	6	250	1500
0,3	0,6	2	1,2	7	8,4	250	2100
0,3	0,6	4	2,4	10	24	250	6000
0,3	0,6	4	2,4	15	36	250	9000

* В таблице одно плечо рассчитывается для числа 2, три плеча для числа 4.

Выводы:

1. Мы не можем торговать с комиссией больше чем 0,01% от оборота, так как еще и биржа заберет свои 0,01%, что в сумме даст 0,02%.

2. С затратами в сумме 0,02% от оборота мы не можем использовать плечи, которые предоставляет нам брокер.

3. Мы обязаны убрать из условий договора, что минимальный оборот в день должен составлять 5 миллионов рублей,

чтобы иметь возможность совершать либо одну сделку в день, либо половину сделки.

4. Мы должны иметь возможность совершать сделки на часть нашего депозита, а не на весь депозит внутри дня так, чтобы это не шло в разрез с договором на брокерское обслуживание.

5. Мы должны понимать, что интенсивность сделок (количество сделок в день) ведет к тому, что увеличивается брокерская нагрузка на депозит, а с нагрузкой в 360% годовых – невозможно выжить на бирже.

Главное понять, что ключевой термин тут – брокерская нагрузка на депозит. Если вы подставляете в таблицу количество сделок, которые совершаете в день, умножаете их на комиссионные сборы и у вас получается, что брокерская нагрузка на депозит больше 100% годовых, то вы открыли вклад, по которому ставка минус сто процентов годовых. Стали бы вы открывать подобный вклад, если бы вас предупредили и разъяснили все условия честно? Не думаю, что вы настолько глупы.

Так как мы все тут яркие профессионалы, нам лучше предположить, что у вас есть доходность, которая при указанных условиях дает 200% годовых, и вы их заработали, отдали 100% в виде 500 тысяч рублей брокеру, а сами получили свои 500 тысяч рублей прибыли за минусом 13% налога на прибыль. Вот так нам всем будет гораздо приятнее закончить эту главу. Ах да...13% с прибыли. Пришло время поговорить и о них.

Глава 2

Налоговая нагрузка

Ну, вот... всего 13% с прибыли. Но, нужно понимать, что «Как все мы знаем, деньги не печатают на бирже. Их туда приносят – такие же, как мы трейдеры». Увы, я снова вынужден повторяться.

Что такое эти налоги? Это обязательные ваши потери. Почему я так категоричен, да потому, что если 100 человек, бросили в котел деньги, кто-то из них может взять свои, но если он заработал остальное, то 13% он вынужден отдать государству. И это хорошо, платить налоги нужно, но это означает, что в котел бросили все поровну, но достанет оттуда каждый на 13% меньше от того, что бросил его соперник. Чем можно покрыть закинутые в котел деньги, если оттуда сразу исчезли 13%, если вы физическое лицо и гораздо больше, если вы юридическое?

Только убытками, которые понесут такие же как вы трейдеры. Т.е. мало того, что деньги на бирже не печатают, так оказывается не все принесенные туда средства можно забрать. Кажется бы, это знание не ново, но почему – то о налоговой нагрузке на биржевые торги мало кто и мало где пишет. А ведь эти суммы – так же должна охватывать ваша стратегия. Ведь грош цена той стратегии, которая без прибыли.

Глава 3 Распределение средств

Да, биржа — это большой котел, в котором варятся финансовые институты, фонды, ПИФы, банки, брокеры, трейдеры, большие частные инвесторы, маленькие частные инвесторы и прочие участники. Но, с учетом того, что входной билет на российской бирже, это российский рубль, то и обозначить всех торгующих участников можно просто — трейдеры, они же биржевые маклеры, совершающие сделки с акциями.

Так, что же господа трейдеры, раз мы все равны, давайте нас разложим на успешных и не успешных. Раз есть котел, в котором деньги и эти средства вносим туда только мы со своих брокерских счетов, нам нужно определить правильный порядок, кто и сколько из указанного котла забирает.

В этом вопросе нам никак не обойтись без статьи «Биржевое отягощение».

Переходим к статье и читаем ее внимательно.

Есть большая пирамида. По Сбору средств, так как деньги не печатают на бирже.

Допустим, я нахожусь на ее вершине с депозитом 1.000.000 руб. Я знаю, про скромные тарифы биржи для такой суммы, о которых мы только что прочитали. Но, я успешен и мне «плевать на тарифы».

Я заработал 1.000.000 руб. за год и заплатил брокеру 1.000.000 комиссии. Поэтому вершина выглядит так:

1 год	Seven	17
ДЕПО	Комиссия	Прибыль
1 млн	1 млн	1 млн

Это первая линия. Деньги на бирже не печатают, поэтому нам нужно собрать вторую линию, чтобы прокормить первую.

1 год Вторая линия				
ДЕПО	Комиссия	Прибыль	МНЕ	
1 млн	1 млн	1 млн	200	200 на комисс

× 5

Вторая линия, даже более успешная, чем я. Они заработали себе столько же и заработали мне по 200 тыс. в прибыль и по 200 тыс. на комиссию, так как эти деньги я могу собрать только с нижней линии. Так же пометим, что их должно быть 5 трейдеров, чтобы прокормить себя и первую линию.

Если я заработал 1 млн. и заплатил комиссии 1 млн., **то они уже заплатили комиссии по 1 млн. (в конечном счете 5 млн. руб) и заработали еще по 1 млн. 400 тыс. рублей**

Переходим к формированию Третьей линии.

1 год Третья линия				
ДЕПО	Комиссия	Прибыль	ВТОРАЯ Л.	МНЕ
1 млн	1 млн		500	100
			500	100 на комисс

× 10

Третья линия, уже не может себе ничего заработать, так как все, что она сможет заработать на бирже, ей нужно будет отдать наверх, чтобы кормить первые две линии. Т.е. именно с денег третьей линии, вторая линия собрала прибыль и комиссию для меня, а также собрала прибыль и комиссию для себя.

Поэтому результат третьей линии, в которой должно быть 10 трейдеров, такие:

1 млн. комиссии (10 млн. за всех) + по 500 тыс. на комиссию и прибыль для второй линии + по 100 тыс. на мою комиссию и мою прибыль. Суммарно они заработали 2.200.000 рублей, что говорит, что они хорошие трейдеры, но они не смогли заработать ничего себе.

Переходим к формированию Четвертой линии.

1 год		Четвертая				× 20
ДЕПО	Комиссия	Прибыль	третья	ВТОРАЯ Л.	МНЕ	
1млн	500	-500	0*** 500	250 250	50 50	на комисс

Четвертой линии уже тяжело, но они обязаны собирать деньги наверх, для первых линий, так как деньги не печатают на бирже и прибыль одних, это убыток других. Брокер им даже снизил комиссию в два раза. Чтобы держать их в системе.

Итак, у четвертой линии 500 тыс. заплачена комиссия... и дальше мы видим не прибыль, а убыток на депозите, что четвертая линия уже за свой счет, покрывает комиссию для линии №3. Так же им нужно собрать по 250 тысяч для линии №2 и по 50 тысяч для меня. Их должно быть уже 20, чтобы собрать столько денег.

Итог: 4 линия заплатила 500 тыс. комиссии (10 млн. за 20 чел.) и 600 тысяч рублей отдала НАВЕРХ, т.е. они отличные трейдеры, они смогли заработать на пониженной в два раза комиссии 1.100.000 рублей, правда у самих у них исчезло полдепозита. Так как с каждой линией Принцип Биржевого Отягощения УВЕЛИЧИВАЕТСЯ.

Переходим к формированию Линии №5.

1 год		Пятая				× 40
ДЕПО	Комиссия	Прибыль	Четвертая	третья	ВТОРАЯ Л.	
550	-550		0*** 250	0*** 0***	125 125	25 25
						на комисс

Дальше пятой линии, нет смысла продолжать. Принцип Вы поняли. Эта линия условно последняя.

Их должно быть 40 трейдеров. Чтобы прокормить все линии наверху. У них депозит 550 тысяч рублей. Их ПОЛНОСТЬЮ ОСВОБОДИЛИ ОТ КОМИССИИ. Так как они ее не тянут. И они отдали весь свой депозит 550 тысяч, чтобы прокормить 4 линии наверху.

Выводы

1. Чтобы зарабатывать первые две линии, третья линия должна

работать бесплатно, а остальные должны терять. При этом уже 5 линия даже с нулевой комиссией теряет полностью все.

2. При этом брокер, пока может, собирает комиссию с тех, кто может платить. Но уже на 4 и 5 линии он полностью останавливает свое давление, так как просто нет уже столько участников, чтобы привлечь их для кормления пирамиды.

3. Есть участники, зарабатывающие их можно пересчитать по пальцам. На них брокер будет увеличивать свое давление и постоянно увеличивать им нагрузку на депозит. Поэтому если зарабатывающий клиент отказывается платить завышенные комиссии – ему закрывают счет.

4. На средних линиях, брокер ослабевает свое давление на тех, кто в нуле, им снижается комиссия, так как они должны кормить те линии, которые находятся выше, а на тех верхних линиях брокер собирает повышенные комиссии.

5. Те же игроки, которые сливают депозиты, им брокер снижает комиссию практически до нуля, чтобы оставить их в системе, чтобы они кормили все верхние этажи, но их слишком много и их нужно постоянно обновлять в системе. Не будет низших этажей, с нулевой комиссией, которые сливают полностью депозиты, не будет денег для верхних этажей, на которых комиссия собирается.

Это все простая математика. Поэтому мечтающие в геометрической прогрессии увеличивать свои счета сталкиваются с тем:

1. Заработал – брокер вдруг увеличивает комиссию или закрывает счет.

2. Потерял – вдруг идут на уступки и снижают комиссию.

И это в нашем анализе, мы даже не стали учитывать налоговую нагрузку на депозит. Не было смысла нам мелочиться, учитывая давление, которое оказывает – Биржевое отягощение.

Доказательство кукла

То, что вы прочитали в данном разделе, есть прямое доказательство существования Кукла.

Кукл – это первые две линии сообщества трейдеров. Они

имеют на своих счетах минимум 80% всех средств и 80% всех денег, находящихся в котле.

Любое движение Куклом, выпотрошит счета 4... 5... 6 линии в кратчайшие сроки... Так как их участь лишь передавать деньги наверх, а не зарабатывать.

И знайте ...и ему понадобятся новые жертвы.

Что, ужаснулись?!

Оказывается, математически мы просто участники пирамиды по сбору денег наверх, единицами успешных трейдеров, которые успевают еще делать откаты вбок – «организациям нас обслуживающим». И как мы видим на вершине, не может быть много героев, иначе третья и четвертая линия – должны состоять из миллионов брокерских счетов.

Почему, же нигде и никогда не рекламируют термин – биржевое отягощение. Почему учат, как заработать денег с помощью технического, фундаментального и графического анализа, но никогда вам не скажут, что кто-то должен собрать для вас ваши денежки, сложить их в пачки, с обязательными параллельными выплатами брокеру и бирже, налоговой и остатки передать вам наверх, раз вы такой успешный. Почему, же вам не скажут, что раз вы успешный, то деньги для вас должны собрать еще более успешные трейдеры, у которых доходность, должна превосходить вашу, почему? Потому, что это все – биржевые тайны и о них вы можете прочитать, только в моей книге, прослышав только мои лекции и пройдя обучение – исключительно у моей персоны.

Вот вам простой пример, как брокер пытается удержать участников 3,4,5 линии в процессе, чтобы они надеялись и продолжали вносить денежные средства на свои депозиты, чтобы кормить более грамотных участников процесса.

Глава 4

Между жизнью и смертью депозита, тонкая нить

Тема: «Увеличение брокерской нагрузки на депозит (в годовых процентах), при снижении комиссии от оборота».

В черном квадрате – ТАРИФЫ. Комиссии в них ОТ ОБОРОТА. Это – ВСЕ ЗОНА СМЕРТИ.

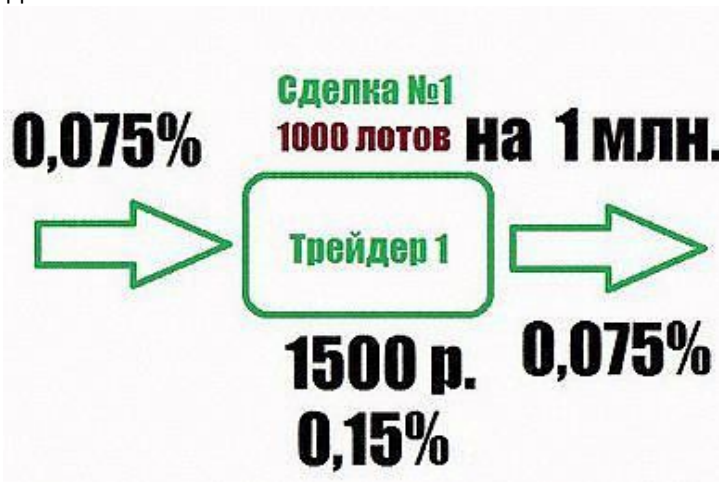
1. Тарифные планы¹

Тарифные планы	Самостоятельный	Активный
Услуга	Стоимость услуги без учета комиссий бирж/торговых систем (НДС не взимается)	
1.1 Покупка и продажа государственных федеральных, субфедеральных, муниципальных и корпоративных ценных бумаг в ТС ФБ ММВБ и ТС ММВБ		
ЗОНА СМЕРТИ		
Оборот в день, руб.		
От 0 до 50 000 включительно	0,165	0,330
Свыше 50 000 до 500 000 включительно	0,125	0,170
Свыше 500 000 до 1 000 000 включительно	0,075	0,125
Свыше 1 000 000 до 2 000 000 включительно	0,045	0,063
Свыше 2 000 000 до 10 000 000 включительно	0,035	0,048
Свыше 10 000 000 до 50 000 000 включительно	0,030	0,035
Свыше 50 000 000 до 100 000 000 включительно	0,012	0,017
Свыше 100 000 000	0,006	0,012

Только с оборотом 100 млн. в день, вроде как начинается – Зона жизни.

У Вас есть оборот 100 млн. в день? Если нет, то тогда вы в Зоне Смерти.

Итак, с такими тарифами видно, что Деньги у нас даже с дневным оборотом 10 млн. рублей, только у не очень умных людей.



Доказательство:

1. У вас 1 миллион на депозите.
2. У вас оборот 4 млн. в день. Это всего ДВЕ сделки. Так как купил + продал, это одна закрытая сделка.
3. Вот ваш расчет $4.000.000/100*0,075\% = 3000$ руб. в день.
Это Ваш тариф + Сбор биржи.
4. 250 сессий * 3000 руб. = 750.000 руб.
5. Это 75% нагрузка на Ваш депозит в год.

Вы открыли у брокера счет под МИНУС 75%.

Думаю, что не станет уже вашего миллиона за полгода такой торговли.

Что делать, снижать сразу обороты? Естественно!

Пересчитаем...

Те же условия, у Вас 1 млн. рублей.

Делаем оборот 1 млн. в день. Купили на половину депозита и продали на половину депозита.

Вот расчет:

1. $1.000.000/100*0,135\% = 1.350$ руб. в день (комиссия при обороте 1 млн + сбор биржи)
2. 250 сессий * 1.350 рублей = 337.500 руб.
3. Нагрузка 33,7% в год на депозит.

Но, мы видим, что в первом случае, что комиссия в процентном выражении вроде меньше, а платим мы со своего счета больше.

Вывод: «при Увеличении оборота, «якобы комиссия берется меньше», так как она снижается, но в натуральном выражении она растет, а также и растет и годовая брокерская процентная нагрузка на ваш депозит.

И контрольный пример:

1. У вас так же на счету 1 млн.
2. Оборот 8.000.000 руб., при нем комиссию Вам снизят до 0,055%.
3. $8.000.000 \text{ руб.}/100*0,055=4.400$ руб.
4. Нагрузка $250*4.400\text{руб.}=1.100.000$ руб.
5. Нагрузка 110% на депозит в год.

Вы открыли депозит под 110% годовых.

ВЫВОД: Брокер Вас убеждает, что, увеличивая оборот, комиссионные сборы для Вас становятся меньше, **НО ХОТЬ ОДИН БРОКЕР СКАЗАЛ ВАМ, ЧТО ПРИ ЭТОМ РАСТЕТ ГОДОВАЯ ПРОЦЕНТНАЯ НАГРУЗКА НА ДЕПОЗИТ?**

Хоть на одних **ОБУЧАЮЩИХ КУРСАХ ВАМ РАССКАЗАЛИ об ЭТОМ?**

Глава 5

Неоценимые заслуги

Раз уж мы стали разоблачать деятельность брокерских компаний в чистом виде, то давайте бросим и камень в огород их услуг, что же по факту они теряют, и за что мы платим такие огромные комиссионные. Видимо они дают нам в пользование огромные ресурсы, обеспечивать поддержание которых – их огромная заслуга.

Цепная реакция. Круговая порука.

Чтобы перейти к цепной реакции, нужно повторить из Арифметики:

Тариф 0,025% (Следует отметить, что на сегодняшний день такие тарифы считаются Интенсивными и вам необходимо совершить сделок в диапазоне от 1 млн.руб. до 5 млн. руб., чтобы указанный тариф Вам предоставили, а это в среднем 10 сделок в день, на приличном депозите).

1. Вы торгуете очень Хорошо у вас 10 сделок = $0,025 * 2 * 10 = 0,5\%$

Т.е. Вы платите с вход/выход и так 10 раз, Вы должны зарабатывать больше чем полпроцента в день, так как Вы вложили деньги в Биржу и начинаете платить 125% годовых сразу.

Очень «хороший вклад» я вам скажу, изначально деньги вложены под МИНУС 125% годовых.

Но, постойте, Вы же хороший трейдер, поэтому 1 плечо, а, это уже нагрузка 250% годовых на депозит. Тогда 3 плеча 375% годовых...4 плеча...500% годовых!

Господа трейдеры, прежде чем делать вклад в свое будущее подумайте, осилите ли Вы ношу в минус 500% годовых по такому вкладу?

Есть ли у Вас стратегия, дающая больше денег?

Поэтому первые правила для указанного тарифа 0,025%

1. Нет кредитным плечам. Тогда платите за Услугу 125%.
2. Нет никаких 10 сделок, есть только одна сделка, тогда это 12,5% годовых.

Если Вы с этим согласны, то переходим к ЦЕПНОЙ РЕАКЦИИ и КРУГОВОЙ ПОРУКЕ.

Итак. Цепная реакция.

Условие:

У брокера есть 1000 лотов, это акций 10.000 акций по цене 100 рублей. Стоимостью 1.000.000 рублей.

Если вычисления в предыдущей строке правильные, то читаем дальше.

Есть на бирже трейдеры, они обслуживаются у брокера по тарифу 0,025%. Их сто человек. И они решили начать делать сделки. Начнем с первой сделки. Она выглядит на рисунке так:

Цепная реакция. Круговая порука.



Рис.1. Сделка.

Нагрузка по этой сделке 0,05%. На 1000 лотов, это покупка + продажа. Оборот 2.000.000 рублей и это 500 рублей.

Пусть трейдер №1 был в сделке условно 1 минуту, нам не интересно получил он профит по сделке или убыток, нам важна в расчетах ТОЛЬКО КОМИССИЯ.

Как только трейдер продает, то его продажа, это начало сделки второго трейдера по покупке. На рисунке переход от сделки к сделке выглядит так:

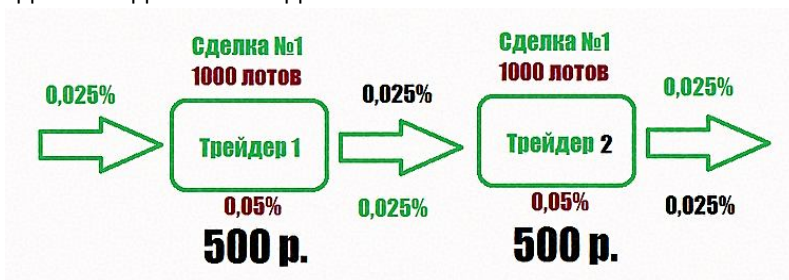


Рис.2. Первая сделка второго трейдера открыта, сделка первого трейдера завершена.

Естественно, брокеру не стыдно, за то, что он с обоих участников сделки взял комиссию, как не стыдно за это и бирже, которая также с каждого взяла по 0,01%.

Далее, каждый трейдер держит акции определенный интервал, мы допускаем, что это 1 минута, для простоты вычислений.

Вот и второй трейдер продает эти 1000 лотов...третьему трейдеру, третий четвертому...и так далее начинается – ЦЕПНАЯ РЕАКЦИЯ.



Рис.3 Цепная реакция.

Мы допустили, что у брокера есть 100 трейдеров, поэтому они продают одни и те же 1000 лотов друг другу по очереди, так как очень любят интрадей (торговля внутри дня), нам нужно всего 100 минут, чтобы круг замкнулся и трейдер №99 продал свои акции трейдеру №1.

Что мы имеем, когда первый трейдер №1 покупал, то, чтобы круг замкнулся, трейдер №99 просто шортил (сделка от продажи)... и своей сделкой по покупке акций у трейдера №98... он просто закрывает свой шорт.

КРУГ ЗАМКНУЛСЯ, это КРУГОВАЯ ПОРУКА.

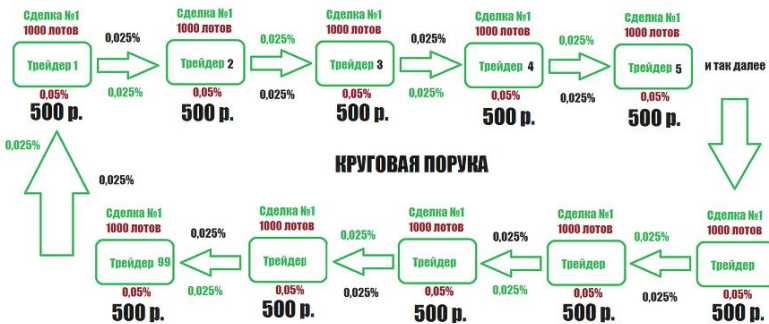


Рис.4 «КРУГОВАЯ ПОРУКА».

Итак, круг замкнулся, что мы имеем:

1. Сто трейдеров завершили сделки у одного брокера.
2. Они работали всего с 1000 лотов стоимостью 1.000.000 рублей.
3. За круг они заплатили брокеру 50.000 рублей комиссии.

Так, вот, господа... брокеру нужно всего, чтобы вас было 100 и вы совершили по 20 сделок... и он уже получит 1.000.000 млн. рублей комиссии. Т.е. ровно столько, сколько стоят 1000 лотов, которыми он вам дал поиграть... и брокер может купить себе в пользование...еще 1000 лотов... и так – каждый рабочий день.

Мало того, что при этих условиях изначально деньги вложены под МИНУС 125% годовых. Это Ваша брокерская нагрузка при 10 сделках, пересмотрите наши расчеты.

Так брокер оказывается на 100 трейдерах и 20 сделках ЗАРАБАТЫВАЕТ 1.000.000 комиссии, за то, что вы как дети в песочнице играетесь 1000 лотов.

Он каждый день, получая, на такой круговой поручке 1.000.000 рублей, может покупать себе 1.000 лотов акций и давать их поиграть – другим дурашкам.

Итак, вы продолжаете замыкать круг 20 раз все 250 рабочих дней.

Брокер получит 250.000.000 комиссионных.

Где он их возьмет? Деньги не печатают на бирже, а вас всего 100 чел. изначально с 100 миллионами на всех.

Т.е. круговая поручка Вас съест за долго до того, как закончится год.

Удачи в торгах. Делайте Выводы.

Глава 6

Горизонт инвестирования для счета. Течение одной сделки во времени

На бирже могут выиграть только те деньги, которые вы отнесли туда с четким знанием того, что они там могут пролежать сколь угодно долго, прежде чем вы изъявите желание ими воспользоваться. Нахождение вашего капитала на бирже, есть не что иное, как – горизонт инвестирования.

Нам нужно четко понимать, что у крупных игроков не только денежных средств и акций больше, у них и горизонт инвестирования намного дольше, чем у обычного частного инвестора.

Что же такое убыток, на временном интервале инвестирования и откуда он берется. Все убытки берутся – исключительно от сделок, которые уже зафиксированы и зафиксированы в минус. Если вы открыли сделку, то на вашем счету появляются акции и вы, невзирая на их текущую цену, можете держать их сколь угодно долго, пока не продадите с прибылью. Но, если вы вдруг ошиблись с входом в сделку и цена пошла против вашей позиции, то тут начинает работать против вас – горизонт инвестирования средств. О чем это говорит? О том, что вам нужно нести на биржу, только ваши личные средства, ни в коем случае не брать кредиты и не занимать у родственников. Потому, что если ваши родственники резко попросят деньги, то вам нужно закрывать позицию в убыток и возвращать долги.

Рекомендуемый горизонт инвестирования денежных средств в акции от трех лет, это позволит вам минимизировать риски закрытия позиции в убыток в связи с окончанием срока инвестирования.

Итак, из основ горизонта инвестирования мы видим, что основную роль в получении нами прибыли играет время размещения наших денежных средств на бирже. Влияет ли этот глобальный момент знаний, на отдельные сделки, совершаемые трейдером?

Естественно, да. Любая сделка после входа в позицию, это

ни что иное, как ожидание изменения цены во времени. Чем больше времени мы ждем, тем больше сделок производят в инструменте (выбранной вами акции для торговли) другие участники торгов. Соответственно и результат изменения цены относительно вашей точки входа в позицию будет больше, чем больше времени пройдет с момента входа. И это аксиома. А чем больше временное отклонение от точки входа, тем больше либо прибыль, либо убыток.

Вы можете возразить, что если вовремя не зафиксировать прибыль, то цена может вернуться обратно, и ваша прибыль также легко исчезнет с вашего счета, как и появилась там. Но, мы подразумеваем, что знаем, когда забирать прибыль на счета, мы сейчас ведем речь лишь о теории биржевых торгов и нам главное усвоить термины и понятия, а также выяснить, в чем же заключается суть биржевых торгов и на каких постулатах основан момент получения прибыли.

Поэтому, установим, что ведем речь о максимальном значении отклонения цены от точки входа в течение определенного интервала времени. Т.е. ведем речь об экстремуме отклонения цены от точки входа. Соответственно окончательную мысль выразим так: «С момента точки входа в рынок, максимальное значение экстремума отклонения цены от точки входа, находится в прямой зависимости от времени нахождения в позиции. Чем больший временной интервал охватывает наша сделка, тем значение экстремумов на указанном интервале – выше».

Для примера возьмём участок длиной в год.

Да, естественно, что максимальное значение может выпасть и в первый месяц, но, это не сможет идти вопреки нашему заявлению, так как на участке в год, этот экстремум будет не больше максимального, а лишь равен ему. Т.е. частный случай, нашу теорию не опровергает, поэтому идем в наших рассуждениях дальше.

К чему все эти рассуждения? – зададитесь вы вопросом. Да лишь к тому, что если максимальное отклонение цены от точки входа находится в прямой зависимости от времени нахождения в позиции, то, чем меньше это время – тем меньше разброс

цен. Это нас приводит к тому, что если мы возьмем локальный участок длиной в час и совершим там как можно больше сделок, то мы лишь заплатим много комиссии брокеру и бирже, а сами попадем под давление короткого отрезка времени, на котором сильное отклонение цены от точки входа – маловероятно. Есть, конечно, редкие исключения из правил, но они настолько редки, что их не стоит отдельно описывать в общей теории системной торговли. Итак, нам нужно лишь сделать выбор, нужны ли нам интенсивные сделки на коротком участке течения времени, на котором выпадение экстремума отклонения цены от точки входа – маловероятно.

Если, нам это не по душе, тогда мы начинаем просеивать через себя знания основ системной торговли на рынке акций. И понимаем, что интенсивная торговля на коротком промежутке времени, без возможного выпадения экстремумов, никак не может увеличивать нашу прибыль – даже в теории. А с учетом биржевых комиссий и сборов – просто вгонит нас в значительные минусы по результатам нашей торговли.

Итак, постулаты. Максимальное значение экстремумов возможны лишь на максимальных временных интервалах нахождения в позиции.

Соответственно, в построении системы торговли нам нужна та золотая временная середина, которая избавит нас от интенсивности сделок на коротком промежутке времени. Также избавит нас от просиживания в позиции, до момента, когда цена вернулась к нашей точке входа. А совокупность этих знаний, приведет нас к сделкам, в которых мы будем находиться в позиции ровно столько, сколько нам требуется времени, для выхода из позиции по экстремуму на выбранном нами участке времени.

И решение этой задаче есть, и оно не очевидно для всех участников рынка, а очевидно для нас.

В построение нашей системы мы будем использовать сразу ДЕВЯТЬ тайм-фреймов. Т.е. практически все тайм-фреймы от малых к глобальным, но выстроим на основе этого знания систему распознавания сигнала, которая будет выбирать для нас

как сильные, так и слабые развороты рынка методом «кодового замка», а именно методом совпадения сигналов на определенных временных фреймах (участках).

Как это совместить и сделать так, чтобы работало, вы узнаете из этой книги.

Но, сначала проведем анализ операций от Лонга и от Шорта.

Глава 7 SHORT and LONG

Рассмотрим элементарные математически расчеты, по простым позициям SHORT и LONG

На первом рисунке доходности трех временных периодов по операции ШОРТ.

Вычисления элементарные.

1) 1 год 100 р.	1/2 года	1/10
	50 50 	20 20 20 20 20 <small>1 2 3 4 5</small>
10 р.	10 10	10 10 10 10 10
Итого: 190 р. 90% годовых.	180 руб. 160% годовых.	150 руб. 500% годовых.

Выводы:

1. Чем позже шорт, тем выгоднее.
2. Сидеть долго в шортах – плохо.
3. В шортах – вы замораживаете актив.

Поэтому, все разговоры о том, что биржа и брокеры дают вам зарабатывать в обе стороны – абсурдны.

Даже увеличивая позицию по ходу падения на «всю маржу» (прибыль в моменте от удержания позиции), вы не сможете в разы исправить ситуацию, а увеличите свой риск – действительно в разы.

Можете проверить, а если жаль времени – поверьте на слово.

1) 1 год	1/2 года	1/10
100 	100 50	100 90
10		
Итого: 1000%	100%	11%

Для справедливости стоит отметить, что в таблице во втором столбике, если брать в годовом выражении, это 200%, так как результат 100% мы получаем, инвестируя средства на срок 6 месяцев. Соответственно и в третьем столбце в годовом выражении, проценты будут в районе 110% в год.

ЛОНГ:

1. Чем раньше и дешевле купил, тем лучше.
2. Купил и держи, никому не отдавай.
3. Любые покупки позже – принесут значительно меньше денег.

Этот пример, вам легко доказывает, что любой «интрадей», который вам пропагандирует брокер – лишь убивает вас комиссией (а комиссии нынче дикие), как только вы вышли из позиции, то последующие покупки – принесут вам в разы меньше прибыли.

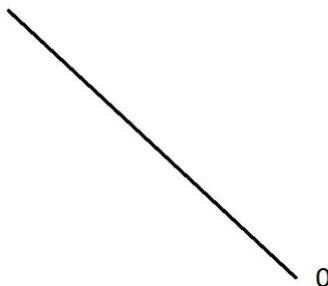
Поэтому вывод простой, купи как можно ниже, а держи как можно дольше.

Глава 8

Страхи трейдера. Рыночное равновесие

Настоящий трейдер может не заработать, в своем инструменте, только если график цены от его первого входа выглядит как на рисунке №1.

Вход в сделку

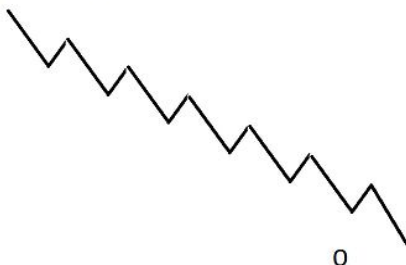


Т.е. это в буквальном смысле – ровная прямая линия, угол наклона которой, это лишь следствие течения времени.

Для того, чтобы построить такой график в инструменте, это нужно всем участникам рынка сговориться, и выполнять сделки исключительно точно, чтобы линия была безукоризненная.

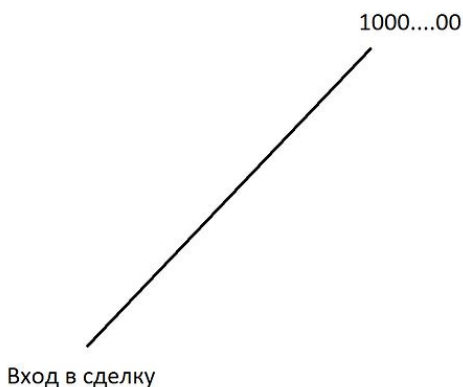
Теперь посмотрим на рис 2.

Вход в сделку



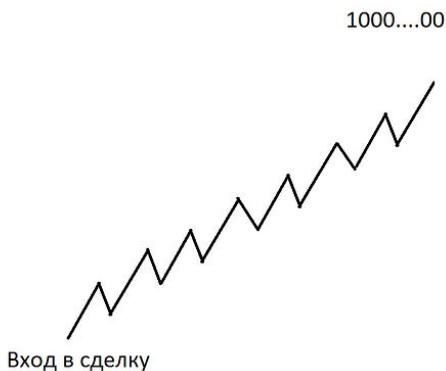
Если график цены, после вашего первого входа выглядит так, то, в данном случае вы можете потерять, но не более 10-20% от депозита, если вы – трейдер.

Рисунок 3.



Вы заработаете, но один раз.

Рис.4.



Вы заработаете, но не много.

Заключение:

Если графики цены в Вашем инструменте, характерно отличаются от 4 моделей мной предложенных, то вы должны зарабатывать очень хорошие деньги, если конечно вы – трейдер.

Теперь два списка равновесия.

Скорость уменьшения суммы депозита растет:

- Большие плечи.
- Большие комиссии.
- Большое количество инструментов для торговли.
- Большое количество сделок.

- Используем не только лонг, но и шорт.
- При таких условиях – прибыли нет и не будет, крах неизбежен. Второй список, это при котором есть прибыль.
- Нет шортам.
- Комиссия ничтожная.
- Нет плечам.
- Сделки совершаются на нужную часть депозита.
- Вход частями.
- Мало инструментов для торговли.
- Количество сделок сведено к нужному минимуму.

Как видим, все 7, нужных для получения прибыли пунктов, которые находятся на нужной стороне весов, приводят нас к **МИНИМИЗАЦИИ ПРОГНОЗИРУЕМОЙ ПРИБЫЛИ**.

Поэтому, и не удивительно, что те трейдеры, которые познали в бирже больше других, крутятся вокруг нуля. Кто же зарабатывает на бирже? Вопрос ставим исключительно по трейдерам, а не по брокерам и бирже, которые забирают 95% денег с рынка. Добавляем в список номер два, самый важный пункт №8.

8. Все сделки совершаются с прибылью.

И как антагонист в первый список добавляем пункт

6. Сделка может быть закрыта в убыток.

Соответственно по логике вещей из последнего выходят еще по добавочному пункту в каждый список.

В первом списке:

7. Используем стоп-приказы.

Во втором:

9. Не используем стоп-приказы.

Итак, две стороны весов и итоговые два списка:

ПЛОХО:

- Скорость уменьшения суммы депозита растет:
- Большие плечи.
- Большие комиссии.
- Большое количество инструментов для торговли.
- Большое количество сделок.
- Используем не только лонг, но и шорт.
- Возможность фиксации убытков.

- Использование стоп-приказов.

ХОРОШО:

- Нет шортам.
- Комиссия ничтожная.
- Нет плечам.
- Сделки совершаются на нужную часть депозита.
- Вход частями.
- Мало инструментов для торговли.
- Количество сделок сведено к нужному минимуму.
- Никогда не фиксируем убыток, все сделки только прибыльные.
- Нет стоп-приказам.

А между ними — ДОХОДНОСТЬ НОЛЬ.

Высокоточные сигналы на вход в рынок.

Методика распознавания

1. Визуализация сигнала.

А) Мы придерживаемся строго формализованной и системной торговли.

Б) Мы не работаем исключительно по графику цены и объема.

В) Мы настроили собственную систему распознавания сигнала, дали ей условное название «Шаблон».

Д) Система распознает разворотные точки рынка, как локальные, так и глобальные.

Трейдеру, для принятия взвешенного решения, необходимо затрачивать как можно меньше времени, на анализ ситуации.

Наша система, в данном случае работает как навигационная карта, либо как крапленые игральные карты при выборе хода.

Если рынок дает сигнал на вход в позицию, то мы видим его раньше других участников рынка, так как используем настройки технических индикаторов, которые систематизированы, как единый инструмент для визуализации сигнала.

2. Виды сигналов.

А) Мы классифицировали сигнал по шкале от слабого к сильному.

Б) У нас отсутствует двойное прочтение сигнала.

В) Однозначность выводов по сигналу, позволяет всем участникам, использующим наш Шаблон, входить в позицию по одному и тому же сигналу без задержек.

Г) Наша система не выдает ошибок, так как в своих настройках использует фильтры, снижающие погрешность, а также статистическую информацию, накопленную рынком, по предыдущим разворотным точкам.

Сигналы делятся:

1. Слабый.

2. Полутон либо сигнал продолжения.

3. Средней силы.
4. Сильный.
5. «Парад Планет» – глобальный сигнал на разворот рынка.

3. Шаблон

1. Используем систему Quik
2. Основной Шаблон на каждый торгуемый инструмент состоит из трех вкладок.

- A) ИНТРА
- Б) МЕДИУМ
- В) ГЛОБАЛ

Также используем дополнительные вспомогательные вкладки:

- «Конверт» (Использует уровневые индикаторы)
- «Поддержки» (Использует индикаторы направления)

A) Вкладка «ИНТРА» – набор технических индикаторов, способных визуально ловить развороты рынка на локальном периоде, для работы внутри дня.

Используется трендовый индикатор, Осцилляторы, Индикаторы смены настроения рынка, Индикаторы покупок и продаж, фильтры.

Тайм-фрэйм 3, 6, 10

Б) Вкладка «МЕДИУМ» – используются те же индикаторы

Тайм-фрэйм 15, 30, 60

В) Вкладка «ГЛОБАЛ» – используются те же индикаторы

Тайм-фрэйм 4ч, день, неделя

4. Расшифровка сигнала Шаблона

1. У трейдера, использующего шаблон, на распознавание сигнала уходит меньше 30 секунд.

2. Используются ДИВЕРГЕНЦИИ на различных тайм-фрэймах и различных технических индикаторах.

3. После распознавания сигнала, ему присваивается «категория сигнала» в зависимости от силы.

4. Сильный сигнал, необходимо «работать сильной рукой!», т.е. входить в позицию более мощным объемом. На более долгий срок.

Общий срок понимания работы Шаблона составляет один год. Но уже после 2-3 месяцев обучения, трейдер использующий указанную систему, сможет самостоятельно распознавать все виды сигнала.

Обучение включает теорию рынков, много практики и отработки работы при различных условиях на рынке.

Необходимо знать, как шаблон реагирует на кризисы, рост, и боковые движения рынков. Это необходимо, чтобы использовать максимальные возможности системы в любой ситуации.

Шаблон, существующие настройки.

Для получения высокоточного сигнала на вход в рынок, необходимо отобрать в шаблон самые точные инструменты и индикаторы, которые доказали свою техничность на длительном промежутке времени.

Возможно, использование каждого отдельно взятого технического индикатора или его использование на определенном тайм-фрейме, покажет вам отклонения, не дающие возможности делать регулярные точные входы в рынок. Основываясь на его показаниях, вы увидите, что указанный индикатор иногда допускает ошибки и при его использовании в вашей работе могут возникнуть погрешности. Такие отклонения называются «шумами», которые необходимо исключить как правильным подбором параметров технического индикатора, так и методикой правильного прочтения сигнала.

Вводим термин «ФИЛЬТР» для индикаторов Шаблона. Фильтр, это показания дополнительного индикатора, усиливающие или отменяющие сигнал на другом индикаторе.

Выстроив систему на совокупности индикаторов, фильтров, нужных нам тайм-фреймах, мы получили работающую систему, которая распознает различные виды и категории сигналов на вход в рынок. Смотря в шаблон, мы сразу видим все характеристики зарождающегося сигнала на вход в рынок.

Итак, за годы кропотливой работы мы отобрали не только самые точные технические индикаторы, подобрали к ним необходимые параметры и периоды, свели их необходимым об-

разом вместе, но и разработали методiku их правильного прочтения.

После всей перечисленной выше работы, мы получили систему, со своей методикой визуализации сигнала, которая позволяет нам в считанные секунды принимать решения на вход в сделку и выход из рынка.

Наш метод в первую очередь основан на 17-летнем опыте ежедневной торговли на бирже ММВБ.

Для подачи высокоточных сигналов «он-лайн» мы используем технические индикаторы, которые жестко отобраны, выстроены в определенном порядке и в них использованы, необходимые параметры.

Если система верна и работает как часы, то статистика неумолима, она сама со временем еще более уточнит, упрочит и улучшит сигнал с каждым, кто вновь подключится к указанной системе. Ведь чем мощнее транслируется сигнал, чем больший объем денег совершает по нему сделки, тем он точнее.

Исходя из вышеприведенного абзаца, сначала требуется точно попадать в «чужие сломы», тогда со временем чужие развороты рынка станут твоими. Твой сигнал, как мощный ретранслятор, возможно, затмит собой первоисточник. Поэтому с каждым разом, с каждым месяцем и годом видеть сигналы и их отрабатывать, становится все легче и легче. Так как они попросту прирастают мощностью, как тело атлета обрастает мышцами после физических нагрузок и калорийной пищи.

В этом скрыт сакральный смысл сигнала, и с этим бесполезно спорить. Сигнал имеет право на жизнь, и он будет транслироваться и ретранслироваться. И чем точнее он будет в начале, тем точнее и изящнее он станет со временем. Присоединяйтесь к нашей точности (она уже доказана статистикой), делайте сигнал более мощным – и богатейте!

Момент истины.

Нужно признать, что фондовый рынок РФ уже и не такой уж «зародыш», каковым являлся еще 7-8 лет назад. Сегодня на рынке изобилие, как серьезных брокеров, так и около биржевого

планктона, а интернет и реклама кишат ворохом заманчивых предложений о том, как увеличить свое благосостояние в кратчайшие сроки. Новые телеканалы, вовсю продвигающие игру в акции, рождают новых аналитиков, «удачливых инвесторов» и прочие инструменты, с помощью которых вовлекают все большее количество наивных инвесторов «поставить на красное».

Брокеры в это время рубят комиссию, а финансовые институты и фонды жаждут, чтобы наивные инвесторы как можно чаще брали гигантские «плечи», с целью в дальнейшем как можно быстрее обнулить их счет в пополнение своих активов. Ведь деньги на бирже не печатают, одни их приносят, а другие – уносят. Но видимо, пришло время и российскому рынку выйти на новый уровень.

Публика, кишащая в интернет сообществах и безрезультатно ищущая Грааль доходности, устала от ожидания «хлеба и зрелищ», и те компании, которые не сориентируются в ситуации, бесследно исчезнут с рынка. Мало быть просто брокером, нужно предоставлять ворох сопутствующих услуг, которые приносят доход не только тебе, но и твоему клиенту, причем доход реальный. Мало быть просто форумом и предлагать пройти видео-курс обучения, либо построить форум так, чтобы посетители сами обучали и «развлекали» друг друга, нужно большее – показать клиенту свою значимость и силу в «он-лайн» режиме.

Зачем говорить, о том, что нужно инвестору. Это и так ясно как Божий день, инвестору нужны высокоточные сигналы на покупку/продажу акций в режиме реального времени, причем, чем точнее и доходнее, тем больше тебе обеспечено клиентов.

Брать деньги в фонды, обещать одно, а делать противоположное – это альтернатива прошедших времен, публика требует ВСЕ ЗДЕСЬ и СЕЙЧАС.

Люди хотят сделать выбор самостоятельно, торговать сами и сами делать свою доходность. И срез этой публики – самый активный пласт общества, активной и образованной части которой обычной рекламой мозги не запудришь.

Будущее за сервисами, которые транслируют высокоточные сигналы на покупку и продажу акций в режиме реального

времени! И уже эти компании в будущем будут покупать себе и брокеров, и фонды, и банки... и все, что с этим связано. В конце пищевой цепочки, останется только один, который в будущем и будет собирать деньги наивных инвесторов с рынка. Если вы хотите вырывать кусок из этой всеобъемлющей пирамиды под названием рынок, то приготовьтесь к тому, чтобы четко определять сигналы рынка, которые вам дает ведущий и собирающий основные средства участник.

В середине процесса останутся наиболее талантливые – компании и частники, умеющие генерировать и продающие самые точные сигналы. У кого нет сигналов, нет видения рынка через систему, тот изначально за бортом трейдинга. Если ты уцелел, на подходе к этому знанию, смог обойти подводные камни комиссий и поборов, выяснил, как распределить свой капитал на инвестиционном горизонте так, чтобы его не съели как комиссионного донора биржа и брокер, то тебе нужна система. Да, чтобы не остаться с нулевой доходностью, нужно работать по системе, которая как вы уже поняли – единая для успешных игроков.

Выживут единицы, так как точный сигнал – это факт, правда, смысл, это самое сложное, что можно сделать на бирже, и, разумеется, дилетантам тут не место.

Обучение трейдингу на ММВБ.

Наша цель – помочь вам заработать на фондовом рынке.

Для того чтобы заработать на бирже не обязательно вкладываться в акции. Как раз наоборот, нужно как можно дальше абстрагироваться от самого понятия – «акция». Что делают инвесторы и аналитики? Они советуют вкладываться именно в акции. Они вам говорят, что акция «недооценена» или «переоценена», они вам много расскажут про фундаментальные основы эмитента и о перспективах компаний в том или ином сегменте.

Вы читаетесь, наслушаетесь и посмотритесь целого вороха ненужной информации. Даже предположить сложно, что из этого вороха «флейма», среднестатистический инвестор сможет выбрать нужную ему информацию, а главное полезную.

Совершать же сделки на основе разговоров аналитиков – это уже просто неприлично. Чего вы ждете от такой сделки? Как та информация, которую вы выудили из средств массовой информации, будет толкать цену вашей акции в нужном вам направлении? Вы подумайте над этим вопросом, ведь по соседнему каналу аналитик говорил обратное видение ситуации, и вы его «прослушали», а может быть именно «оно» было правильным и верным? А сосед ваш слушал за стенкой именно «соседний» канал, и он как раз совершил обратную сделку, и тоже ждет, что удача улыбнется ему.

Я думаю, что в такой ситуации, вы оба обманули – сами себя, в надежде обмануть друг друга.

Во что же я предлагаю вкладываться на бирже?

Я предлагаю вам вкладываться не в акции, а в «трейды». Скажем в «трейд» с 7 рублей до 17 рублей. Вы в таком случае получите прибыль 10 рублей. Все просто. А главное у вас появится масса времени, которое вы тратили на «прослушивание» басен аналитиков и разных там специалистов. Это время вы потратите – на изучение основ и характеров «трейдов», откуда они берутся и как они происходят. А как только вы научитесь видеть «трейд» от произвольного числа к произвольному числу – вы совершите выгодную для себя сделку. И в момент получения прибыли вам будет все равно, что сказал аналитик по каналу 1 и что сказал аналитик по каналу 2, а главное вам станет все равно на «фундаментал акции» и «перспективы отрасли».

Для более эффективного сравнения мы сразу введем понятие «пушечное мясо».

Торги на бирже – это мясорубка, в которой выживает только сильнейший. Это интересно, сложно, выгодно, но выгодно единицам. Мы шли к выгоде долгие годы, мы много учились и изобретали. Теперь мы зарабатываем, а также за деньги учим зарабатывать других.

Мы предлагаем вам услугу, которая в вашем образовательном процессе трейдера на бирже исключит период «пушечного мяса». Мы предлагаем уникальный продукт, создать который

самостоятельно очень сложно. Это труд не только многих лет. Это история, стратегия, это изощренные уловки, четкие инструкции, цели и их достижения. Мы значительно ускорим процесс.

Через год (а не за 5 торговых сессий) вы будете понимать, что такое трейдинг и сможете торговать самостоятельно. Через три вы станете личностью в мире интернет-торговли. Если у Вас есть желание набить шишки и стать личностью только лет через десять-пятнадцать, попытайтесь пройти такой же путь, какой в свое время прошли и мы.

Искренне желаем удачи и не забывайте, что даже Эйнштейн в свое время тоже учился.

Массовая психология рынка.

А) Смотрим в суть происходящего на бирже.

Б) Делаем анализ, какие деньги выигрывают на бирже и почему.

В) Длительность инвестиции и горизонт, как залог уменьшения риска.

Секреты технического анализа.

Расскажем только методики, недоступные широкой аудитории.

(Построение хитрых каналов по одной точке).

Компьютеризированный технический анализ, как основа системы торговли.

Индикаторы дают более глубокое понимание рынка и поведения биржевых игроков.

Внешние факторы и циклы.

Система ШАБЛОН, основанная на временных циклах, статистике, и математических индикаторах.

Построение собственных настроек, внутри уже работающей системы.

Сложность достижения ценовой прибыли.

Мани – менеджмент и риск – менеджмент, как залог правильного функционирования системы.

Адская мясорубка.

Если вы понимаете, что деньги на бирже не печатают, что одни их туда приносят, а другие уносят, то вы должны понимать, как устроена эта Адская мясорубка. Слева ОГРОМНОЕ жерло для входящего мяса, а справа в сто раз меньшее узкое отверстие для тонкой струйки фарша. Это Фарш забирает успешный трейдер, но не 95-99% фарша достаются успешным трейдерам, если быть оптимистами, то процентов 10 от всей доли мяса, а остальное перемалывается и уходит в скрытое отверстие, из которого питаются биржа и брокеры своими услугами и комиссиями. Ведь в предыдущих главах я раскрыл Вам, сколько вы платите за услугу от 60-800% годовых, вы изначально вешаете гири на свои депозиты.

Мясо перемалывается, и основная часть перемолотого мяса поедается биржей и брокерами. Они зомбируют вас разными ЛЧИ и конкурсами, показывая вам якобы успешных трейдеров.

А начать то нужно с простого, просто попытаться взять себе комиссию, ну хотя бы 0,01%

Т.е., расчет без учета комиссии биржи.

1. Одна сделка, вход и выход, $0,01+0,01 = 0,02$.
2. Мы делаем 10 сделок = $0,2\%$
3. Берем 1 плечо = $0,4\%$
4. Если торгуем 250 дней, то 100% – гири на ногах.

ВКЛАД ПОД МИНУС 100% годовых. Заверяю Вас, Вы не потянете такой вклад. Что нам остается?

Вариант №2

1. Нет плечам 50% годовых.
2. 5 сделок это 25% годовых.

Это Ваш порог, вы можете торговать при такой комиссии, но не более 5 сделок без плеча, так вы уже должны заработать, только брокеру 25% годовых.

Все остальное, 3 плеча...или 10-20 сделок, это бесспорно путь к уничтожению вашего капитала за очень короткий срок.

А с учетом того, что брокеру не нужно, чтобы струйка справа

стала толще, то ему невыгодно обучать вас торговать, ему нужно Вас ЗАМАНИТЬ, чтобы вы были слева, перемололись и он забрал себе весь фарш, чем толще струйка справа, которую забирают трейдеры, тем меньше фарша для брокера и биржи.

Бизнес состоит лишь в том, чтобы заманить мясо, сделать фарш и забрать его себе и взрастить новое мясо с помощью рекламы.

Так как если выходное отверстие сделать больше, то твоя доля прибыли уменьшится, станет не с чего брать комиссию, так как комиссию берут только с денег принесенных.

Если же вы успешный трейдер и получили много профита, то, брокер просто не получил на эту сумму КОМИССИИ, не смог оплатить рекламный ролик, не смог открыть новый филиал для привлечения нового мяса и его бизнес начнет сдуваться.

Обороты будут падать, комиссии станут меньше, станет меньше филиалов, станет меньше телеканалов, станет меньше оборот и на самой бирже, ведь по сути добывающему газ Газ-прому не важно, сколько стоят его акции, он газ добывает.

Он первый раз взял свое от размещения акций на бирже, а дальше его мало интересует ход торгов. Теперь его акции – ваши проблемы, цену нарисуют вам любую, важно лишь количество сделанных вами операций, чтобы насчитать вам большие комиссии.

Купите раз в год. Продайте через год в два раза дороже, и брокер не досчитается огромного куска денег. И бизнес его утихнет, объемы рынка станут смешными.

Поэтому последнее время именно «дэйтрейдинг» преподносится, как самый безопасный вид торговли.

Чтобы вы платили как можно больше комиссий.

Конкуренции брокерского рынка нет, на нем заговор и сговор, была бы конкуренция, стали бы меньше тарифы, стало бы «выходное отверстие мясорубки», которое идет в руки успешных трейдеров – Больше.

Брокеры бы сократили свои аппетиты.

На сегодняшний же момент, только из тарифов 0,03 ясно, что все клиенты мясо и заработать им не дадут.

Это просто нереально.

План брокера прост:

1. Тариф 0,03%
2. Раскрутить на большое количество плечей, количество сделок, как следствие оборот.
3. Забрать себе весь депозит в виде комиссий.
4. Дать денег в телек /оплатить рекламу/.
5. Пригласить следующую порцию мяса.

Если есть компания, которая не согласна с этим, кто начинает снижать тарифы и реально обучать народ торговать, то просто ФСФР – отбирает лицензию.

Что касается частника.

Если фикс комиссия есть, и вы заработали, то вам просто закроют счет. Но, вы же прочтете мою книгу, потому, как информация в ней, мои лекции, запрещены всеми ведущими брокерами страны за анти-брокерскую риторику, то следующая глава будет называться....

Глава 10

Как «отжать» брокера или серфинг счетов

Итак, мы не учредители биржи и не владельцы брокерской компании, у нас не выделена доля с этого бизнеса, которую мы можем, ежегодно забирать в свой карман. Мы частник, «грибник», который пришел на чужую поляну нарвать чужих грибов. Почему я считаю эти грибы – чужими?

Почему я считаю, что их нельзя взять и честно заработать на своем брокерском счете?! Этому есть причины.

Во-первых, брокер и биржа вкладываются в рекламу, рабочие места, офисы, оборудование и инфраструктуру для привлечения новой клиентской базы. Они тратят на это деньги. Также они вкладывают в то, чтобы вся эта инфраструктура, функционировала. Они покупают программное обеспечение, серверы, и многое другое, чтобы этот вид бизнеса мог работать и развиваться. Все это – огромные деньги и они будут взяты только в одном месте – с депозитов их же клиентов. Потому, как у «бирже-брокерского» бизнеса есть только одна доходная часть, это те деньги, которые люди на биржу принесли и сложили на свои брокерские счета в надежде заполучить побольше прибыли. После того, как «бирже-брокер» своим насосом в виде астрономических комиссий брокерской нагрузки на депозит опустошает счета своих клиентов, попутно съедая эти деньги он привлекает на свою территорию новых заблудших и поверивших в свой будущий успех – частных инвесторов.

Как не стать жертвой в борьбе с «бирже-брокером». Мы почерпнули уже много знаний, мы знаем, как избежать огромной брокерской нагрузки на наш депозит, чтобы она не опустошила наш счет, дочитав книгу до конца, мы узнаем и систему торговли, которая в единственном своем роде может привести нас к доходности на бирже. Но, нам необходимо на данном этапе книги забежать вперед, а если мы все-таки заработаем 100% годовых прибыли за год, отдаст ли их нам «бирже-брокер»? Ответ вас ошеломит – вам их не отдадут, попросту – вам не дадут

их заработать. Как только вы быстро сделаете первые 10 или 20, ну может 30% начальному капиталу, вам сразу закроют счет.

Почему?! – спросите вы, да потому, что у брокера всегда есть пункт в договоре, что счет можно закрыть в 4-х дневный срок без объяснения причин и вам понадобится новый паспорт или новый брокер, чтобы открыть счет снова. Почему так происходит? Потому, что, отдавая вам доходность, брокер чувствует, что его обманули. Он привлекает пенсионеров и студентов, продвинутую часть публики, объясняет им, как легко они смогут достичь успеха на поприще частного инвестирования, они приносят ему деньги, но вдруг, эти деньги забираете вы. Соответственно, регулярно теряя деньги, если таких как вы успешных будет большинство, брокер вынужден будет сокращать свои филиалы, так как их просто не с чего будет оплачивать.

Поэтому, как «отжать» брокера – это целая наука.

Итак, мы заранее знаем, что нам нельзя перегревать наш счет. Т.е. нам, если счет не очень большой, попросту нельзя получить на нем доходность больше чем 20-30% годовых, так, чтобы брокер не заподозрил, что он проигрывает, чтобы нам не закрыли счет. Поэтому, если мы сразу серьезно подходим к делу, то нам нужно открыть несколько счетов у нескольких брокеров и возможно на разные имена.

Получив доходность 15-20 процентов на первом счете, мы выводим деньги и переносим их на другой счет, на котором можем продолжать торговать в плюс, получив там доходность 15-20 процентов, мы переводим деньги на третий счет. Это называется «серфинг счетов», т.е. перенося деньги со счета на счет, мы на каждом счете оставляем не перегретую доходность в размере до 20% годовых, а суммарно получаем в итоге 60% годовых и наши счета не закрыты брокером, так как он не смог «отследить перегрев».

Если вы верите в честность брокера и то, что вам не закроют счет при любой доходности, это ваше право, мое право вас предупредить и рассказать честно – как будет.

СИСТЕМА ТОРГОВЛИ Seven_17

Построение.

Построение системы носит последовательный характер. Каждый кирпич в систему закладывается в определенном порядке. Пустышек система не предусматривает. Алгоритм построения прост и понятен.

Первичное построение системы, называем «Грубым построением». Как скульптор, грубо выбираем массу материала и предаем ей первичные формы, наносим нашу массу на каркас системы, как на основной стержень с направляющими.

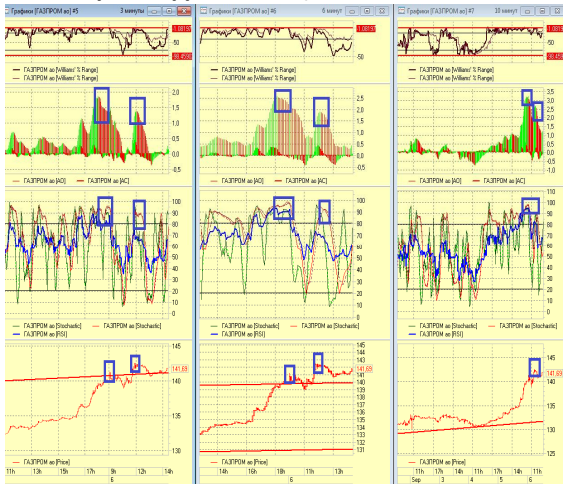
Грубое построение системы.

Произвели отбор индикаторов для системы.

Выстроили их последовательно, согласно характеристик и временных интервалов (тайм-фрэймов).

Настроили уровни первичных, средних и максимальных значений, при которых система генерирует сигнал.

Общий вид системы, ШАБЛОН.



ИНТРА

Очень сильные сигналы

дают по 2 рубля

Вкладка №1 «ИНТРА»

Состоит из трех ТФ 3,6,10 мин., генерирует сигналы для краткосрочных входов.

Сигнал зреет от меньшего ТФ к большему, усиливаясь по мере присоединения дополнительных тайм фреймов.



МЕДИУМ
Сильный на ШОРТ

Вкладка №2 «МЕДИУМ»

Генерирует более среднесрочные и сильные и среднесрочные сигналы.

ТФ 15,30,60 мин.

Если сигнал выпадает одновременно на вкладках ИНТРА + МЕДИУМ, то такой сигнал является самым распространенным видом, более сильным, вход по такому сигналу в рынок, обладает максимальной точностью.



Вкладка №3 «ГЛОБАЛ»

Генерирует долгосрочные сигналы, содержит внутри себя ТФ 4 часа, день, неделя.

Определяет глобальные развороты рынка.

Сигнал ИНТРА + МЕДИУМ + ГЛОБАЛ с максимальным по силе значением параметров, считается ПП (Парадом Планет), и точно указывает Глобальный разворот рынка.

ШАБЛОН. ГЕНЕРАЦИЯ СИГНАЛА.

Высокоточные сигналы на вход в рынок. Методика распознавания.

1. Визуализация сигнала.

А) Мы придерживаемся строго формализованной и системной торговли.

Б) Мы не работаем исключительно по графику цены и объема.

В) Мы настроили собственную систему распознавания сигнала, дали ей условное название «Шаблон».

Д) Система распознает разворотные точки рынка, как локальные, так и глобальные.

Трейдера, для принятия взвешенного решения, необходимо затрачивать как можно меньше времени, на анализ ситуации.

Наша система, в данном случае работает как навигационная карта, либо как крапленые игральные карты при игре против рынка.

Если рынок дает сигнал на вход в позицию, то мы видим его раньше других участников рынка, так как используем настройки технических индикаторов, которые систематизированы, как единый инструмент для визуализации сигнала.

2. Виды сигналов.

А) Мы классифицировали сигнал по шкале от слабого к сильному.

Б) У нас отсутствует двойное прочтение сигнала.

В) Однозначность выводов по сигналу, позволяет всем участникам, использующим наш Шаблон, входить в позицию по одному и тому же сигналу без задержек.

Г) Наша система не выдает ошибок, так как в своих настройках использует фильтры, снижающие погрешность, а также статистическую информацию, накопленную рынком, по предыдущим разворотным точкам.

Сигналы делятся:

1. Слабый.
2. Полутон либо сигнал продолжения.
3. Средней силы.
4. Сильный.
5. «Парад Планет» – глобальный сигнал на разворот рынка.

3. Шаблон

1. Используем систему Quik
2. Основной Шаблон на каждый торгуемый инструмент состоит из трех вкладок.
 - А) ИНТРА
 - Б) МЕДИУМ
 - В) ГЛОБАЛ

Также используем дополнительные вспомогательные вкладки:

- «Конверт» (Использует уровневые индикаторы)
- «Поддержки» (Использует индикаторы направления)
- А) Вкладка «ИНТРА» – набор технических индикаторов, способных визуально ловить развороты рынка на локальном периподе, для работы внутри дня.

Используется трендовый индикатор, Осцилляторы, Индикаторы смены настроения рынка, Индикаторы покупок и продаж, фильтры.

Тайм-фрэйм 3,6,10

Б) Вкладка «МЕДИУМ» – используются те же индикаторы
Тайм-фрэйм 15,30,60

В) Вкладка «ГЛОБАЛ» – используются те же индикаторы
Тайм-фрэйм 4ч,день,неделя

4. Расшифровка сигнала Шаблона

1. У трейдера, использующего шаблон, на распознавание сигнала уходит меньше 30 секунд.
2. Используются ДИВЕРГЕНЦИИ на различных тайм-фрэймах и различных технических индикаторах.

3. После распознавания сигнала, ему присваивается «категория сигнала» в зависимости от силы.

4. Сильный сигнал, необходимо «работать сильной рукой!», т.е. входить в позицию более мощным объемом. На более долгий срок.

«ШАБЛОН», СУЩЕСТВУЮЩИЕ НАСТРОЙКИ.

Для получения высокоточного сигнала на вход в рынок, необходимо отобрать в шаблон самые точные инструменты и индикаторы, которые доказали свою техничность на длительном промежутке времени.

Возможно, использование каждого отдельно взятого технического индикатора или его использование на определенном тайм-фрейме, покажет вам отклонения, не дающие возможности делать регулярные точные входы в рынок. Основываясь на его показаниях, вы увидите, что указанный индикатор иногда допускает ошибки и при его использовании в вашей работе могут возникнуть погрешности. Такие отклонения называются «шумами», которые необходимо исключить как правильным подбором параметров технического индикатора, так и методикой правильного прочтения сигнала.

Вводим термин «ФИЛЬТР» для индикаторов Шаблона. Фильтр, это показания дополнительного индикатора, усиливающие или отменяющие сигнал на основном индикаторе.

Выстроив систему на совокупности индикаторов, фильтров, нужных нам тайм-фреймах, мы получили работающую систему, которая распознает различные виды и категории сигналов на вход в рынок. Смотря в шаблон, мы сразу видим все характеристики зарождающегося сигнала на вход в рынок.

Итак, за годы кропотливой работы мы отобрали не только самые точные технические индикаторы, подобрали к ним необходимые параметры и периоды, свели их необходимым образом вместе, но и разработали методику их правильного чтения.

После всей перечисленной выше работы, мы получили систему, со своей методикой визуализации сигнала, которая позволяет нам в считанные секунды принимать решения на вход в сделку и выход из рынка.

Грубое построение. Часть 2.

Итак, мы выбрали индикаторы для шаблона и составили их в определенном порядке. Получили систему распознавания сигнала, дали системе условное обозначение – «ШАБЛОН».

Система использует как основной сигнал индикаторы:

АО и АС – спаренные вместе, так как АО опережающий, а АС сигнал подтверждение.

В одно окно поставлены «медленный» и «быстрый» стохастики с различными временными периодами и индикатор RSI.

Так же настроен индикатор Williams % Range, как трендовый индикатор «залипания», которое нам помогают определять направление движения или тренд.

Почему «ШАБЛОН»? Потому, что одни и те же сигналы будут постоянно повторяться и «Шаблон» будет их безошибочно характеризовать снова и снова по силе и качеству, согласно заложенным в него настройкам. Никаких «новых» сигналов система нам не выдаст.

ПЕРВИЧНОЕ ИСПОЛЬЗОВАНИЕ.

Система предусматривает первичное использование без изучения деталей и нюансов. Согласно, своей грубой первичной настройке система без посторонней помощи уже анализирует рынок.

Т.е. просто понаблюдав за работой «Шаблона», вы, безусловно, увидите более сильные сигналы, который даст вам рынок.

Но, чтобы использовать всю силу системы «Шаблона», Вам необходимо изучить его с разных плоскостей, более точно и детально.

ТОЧЕЧНАЯ НАСТРОЙКА.

Вам необходимо понимать, что дин и тот же сигнал, может быть разным по силе. Влияние на Силу сигнала оказывает:

Направление тренда.

Глубина индикаторов.

Максимальные значения индикаторов системы.

Последовательное количество «тайм-фреймов» и вкладок в системе сигнала.

Нюансы.

Направление тренда.

А) Не поленились, начертите тренд, чтобы более точно использовать такие виды сигнала, как продолжение тенденции и преждевременно, не начинать искать, точка входа в противоположном направлении.

Б) В боковике система работает точно, даже при средней силе сигналы, уровни боковика и проторговки, самые простые для распознавания сигналов системы Шаблона.

Глубина индикаторов.

А) Максимальная глубина основных индикаторов, дает максимальную силу Сигнала, так как мы используем статистические индикаторы, а статистика и история значений индикаторов, в любом торгуемом инструменте составляют основу силы сигнала.

Максимальные значения индикаторов системы.

А) Всегда показывают глобальный разворот ПП («Парад Планет»)

Б) На каждом этапе «Шаблона», как отдельно для «ИНТРА», так и для «МЕДИУМ», максимальные показания системы – соответствуют самому сильному сигналу.

В) Сигнал усиливается ДИВЕРГЕНЦИЯМИ.

Последовательное количество тайм-фреймов и вкладок в системе сигнала.

А) Нужно понимать, как основу системы, что сигнал «ИНТРА + 15», слабее, чем сигнал «ИНТРА +30», который в свою очередь слабее, чем «ИНТРА + МЕДИУМ» и так далее.

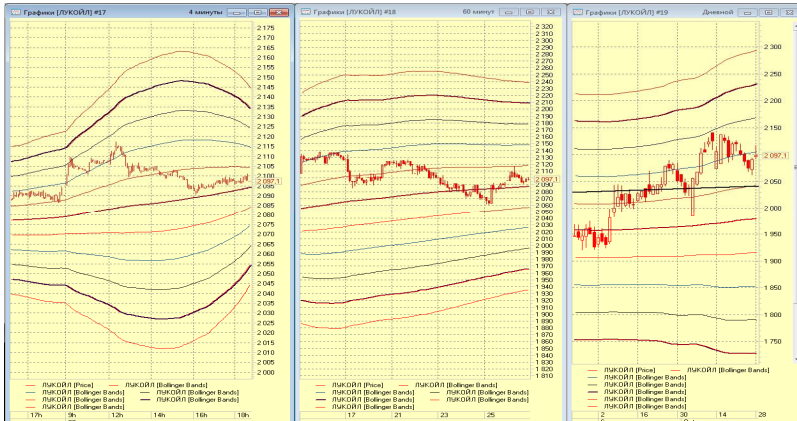
Нюансы.

Необходимо понимать, что сигнал работает на среднестатистических значениях системы, которые показывают максимальное

количество разворотов, но усиливается с отклонением индикаторов в сторону максимальных значений.

Так же сигнал усиливается при дивергенциях в зависимости от временных фреймов. В моменты повышенной ликвидности и при отработке уровней, таких как «горизонты» и «хитрые каналы». Все эти приемы, необходимо использовать параллельно системе Шаблона, в целях более легкого чтения показаний системы.

Также простое использование «Конверта» настроенного на индикаторах «Боллинджера», значительно повышает точность системы.

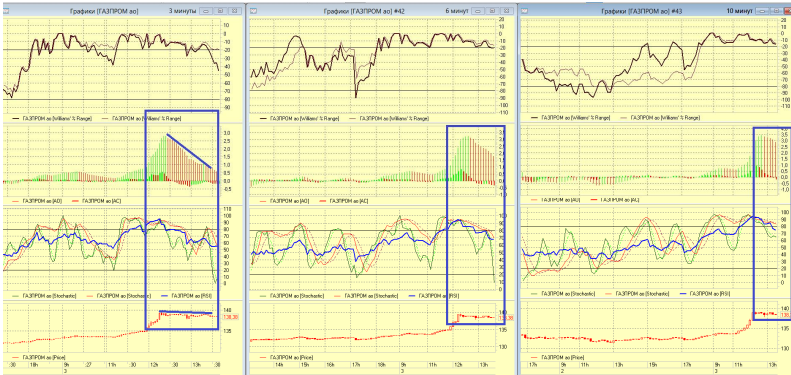


«Конверт». Настроенный на индикаторе «Боллинджера» с периодами 1,2,3,4,5.

Уровни силы сигнала, нам устанавливают максимальные значения индикаторов сигнала на том или ином «тайм-фрейме».

Вводим понятие – Сигнал максимальной силы.

Пример 1.



ИНТРА Газпром - Максимальные значения, высота АО в два раза выше средних уровней.

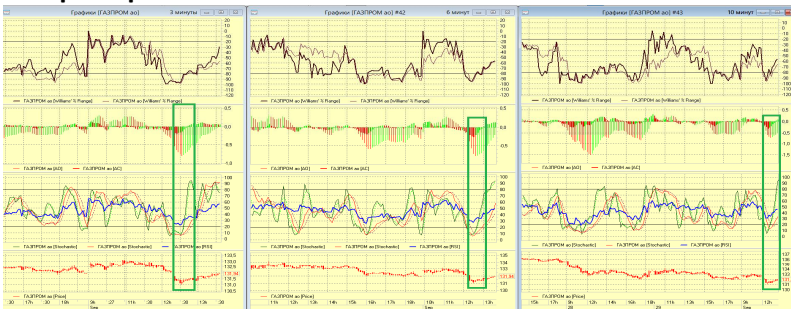
Максимальная высота присутствует на ТФ 3,6,10 мин.

Сильный сигнал на выход из позиции.

RSI - плоский дивер.

Сигнал системы с максимальными по высоте значениями индикаторов – считается сильным и устанавливает статистические рамки, на поиск сильных сигналов в дальнейшем. Сигналы с менее сильными значениями по шкале, переходят в категорию – средних по силе сигналов.

Пример 2.



Сигнал ИНТРА с максимальной глубиной по АО.

Также хорошие показатели стохастиков от минимума.

Силу сигналов нашей системы усиливают дивергенции, поэтому коротко разберем некоторые из них на примере индикатора RSI.

Классификация дивергенций и разбор различных вариантов сигнала в Газпроме на индикаторе RSI 3 мин.

Рис.1.



Газпром, 3 мин.

Варианты возможных сигналов:

- 1. Длинный дивер.**
- 2. Максимальное значение индикатора.**

- 3. Касание первого уровня и отскоковый локальный канал.**
- 4. Плоский средний дивер.**

Рис.2.

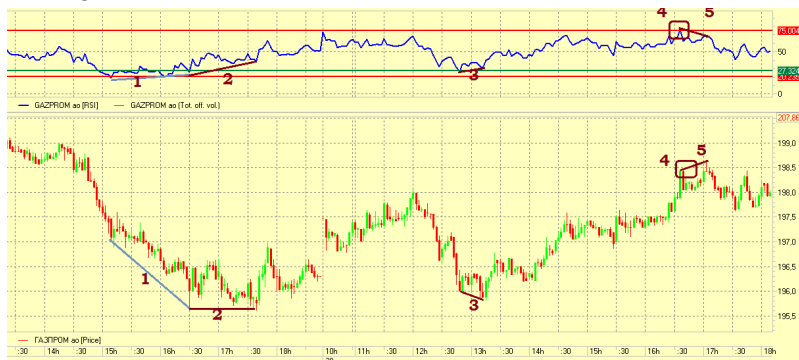


Рис.2 Газпром, 3 мин, варианты сигнала

- 1. Длинный дивер под красным уровнем.**
- 2. Средний плоский дивер под красным уровнем**

- 3. Короткий Дивер на зеленом уровне**
- 4. Максимальное значение.**
- 5. Короткий дивер от красного уровня на ШОРТ.**

Рис.3.

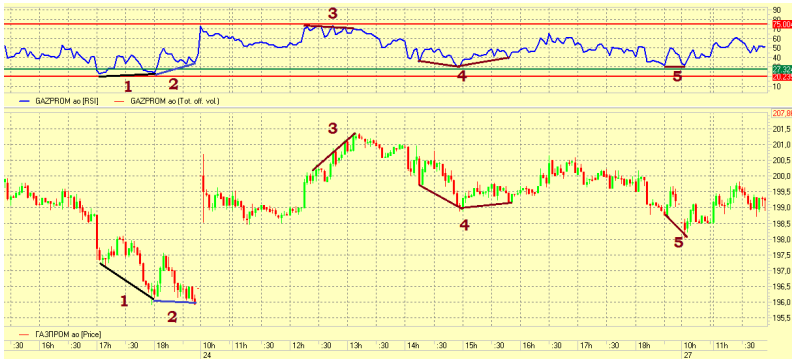


Рис.3 , Газпром, 3 мин, разновидности сигнала

1. Длинный дивер под сильным углом. Любимый прием кула подвести донг под перенос.
2. Плоский дивер, завершающая часть приема кулаа "под ночь"

3. Дивер с резким уклоном на ШОРТ
4. Разворот от зеленого уровня без диверов, при стабильном рыночном движении.
5. Плоский дивер.

В дальнейшем мы продолжим разбирать и визуализировать различные виды сигнала. Преимущества будем отдавать дивергенциям на индикаторе АО с максимальными значениями силы сигнала (глубина, высота линий).

Пример 3.



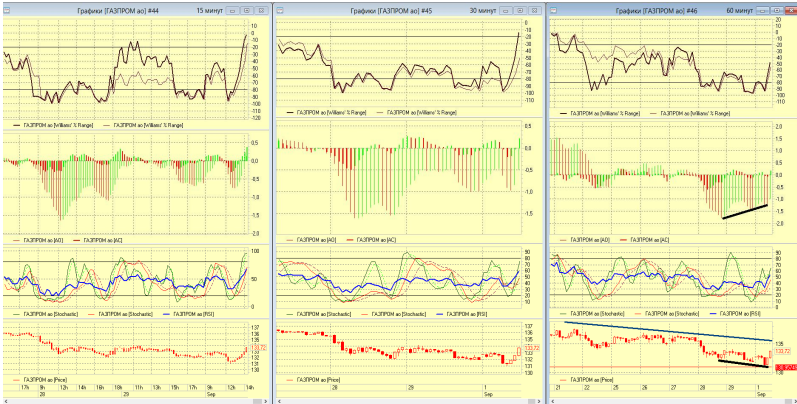
Сигнал с Максимальной Глубиной АО

Сигнал с Сильной высотой АОи дивергенцией на ТФ 3 мин

Сигнал с Максимальной глубиной АО (2)

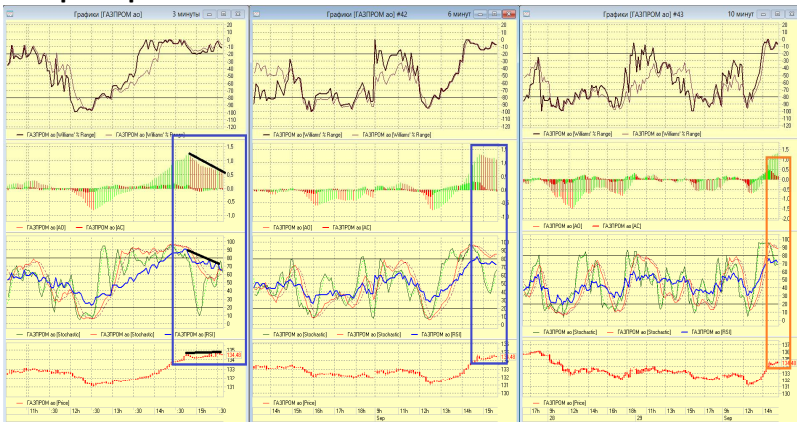
Вывод: Хороший волатильный день с Чистыми сигналами.

Пример 4.



ТФ 60 мин, ДИВЕРГЕНЦИЯ с 3 Вершинами.

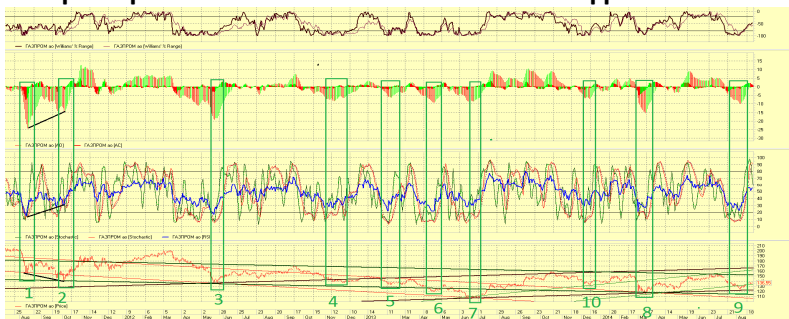
Пример 5.



В газпроме, по ИНТРА, после резкого роста от Сигнала с Максимальными значениями АО, формируется сигнал на сопротивление с направлением движения цены вниз.

На 3 мин, уже есть легкий дивер.

Пример 6. Сигналы на глобальном «тайм-фрейме».



ГАЗПРОМ ТФ ДЕНЬ.
Сильные сигналы.

Сигналы 1,2,3,7,8 - показали глобальный разворот.

Остальные - дали хороший отскок.

За четыре года - сработали все сильные сигналы на ЛОНГ.

В чем залог успеха сигналов, которые сработали на глобальном «тайм-фрейме» день?!

В том, что в момент, когда они сформированы на ТФ «день» – также полностью сформировались сигналы на вкладке Шаблона «ИНТРА+МЕДИУМ» и сила сигнала, многократно увеличилась, так как семь одновременных сигналов на семи «тайм-фреймах» – сильнее, чем сигнал на одном «тайм-фрейме». Совпадение всех элементов кодового замка на множестве «тайм-фреймов» – безусловно, сделали сигнал чистым и мощным для визуального восприятия.

Пример 7. Вид отдельной вкладки «Шаблона».



Пример 8. Вкладка «медиум».



Сегодня 22.08.2014 в Газпроме интересней сигнал, двойной дивер по АО и RSI на ТФ час.

Сигнал силы Средний:

Также видно по трендовому индикатору ВИЛЛ - заплата (что говорило о наличие краткосрочного тренда), тренд резко закончился в момент сигнала.



Пример 9. Сигнал продолжения тенденции. Вкладка «МЕДИУМ».



Сигнал продолжения тенденции на ШАБЛОНЕ МЕДИУМ.

Он же может быть обозначен как сигнал ИНТРА +15.

При условии, что ИНТРА снова показывает ЛОНГ.

Пример 10. Сигналы различной силы, вкладка «ИНТРА».



Сигналы ИНТРА

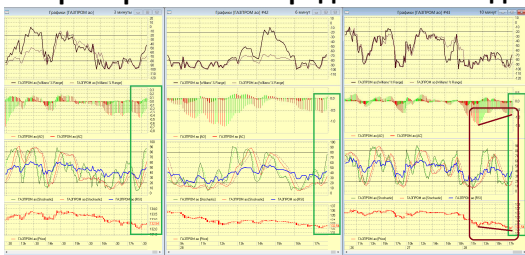


Сигнал, Сила - Выше среднего, достаточная глубина АО, показатели стохастика и RSI "глубокие, на дне", переход цвета по АО - чистый, на тФ 6 и 10 минут, дивергенция по всем индикаторам, на трендовом индикаторе ВИЛЛ, выход с расхождением толстой и тонкой полосы.



Слабый сигнал, нет глубины АО, нет дивергенций, RSI не глубоко в зоне Лонга.

Пример 11. Сигнал продолжения тенденции, вкладка ИНТРА.



Сигнал продолжения тенденции

Дивергенция 10 мин.



Пример 12. Вкладка «ИНТРА» + дивергенция на ТФ 3 мин.



Сигнал ЛОНГ в Газпроме.
Вкладка ИНТРА.

1. Максимальная глубина АО
2. RSI Выходит из зоны 20 вверх.
3. Смена цвета в АО и АС.
4. Резкое движение в Выльемсе.
5. Медленные и быстрый стохастик разворачиваются с максимальной глубиной.

Вывод: "Сильный сигнал".

на тф 3 мин дивергенция

LONG

SHORT

Что нам помогает в работе, кроме точно настроенного Шаблона?!

Правильно, построения различных линий, поддержек и сопротивлений. Мы не будем, вам долго рассказывать обычные примеры технического и графического анализа, мы дадим вашему вниманию построение канала, которое является исключительно нашим изобретением. А именно построение канала, по одной точке.

Да вы не ошиблись, мы разработали методику, как построить будущий канал всего по одной точке и представим ее вам.

Итак, представляем вашему вниманию – «Хитрый канал».



Рис. «Хитрый канал».

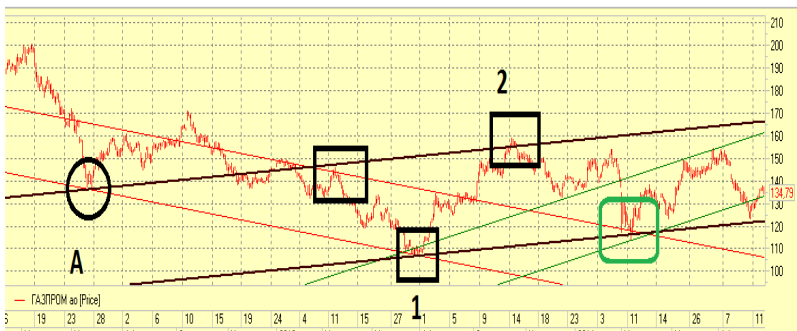
Построение:



Имеем точку «А», как основу для нашего построения.

После того, как через точку «А» и 2 можно провести линию, мы можем предположить, что точка 1, это первая точка поддержки растущего канала. Но, мы знаем, что поддержки строят как минимум по двум или даже трем точкам снизу и направление канала должно быть вверх. Так, вот метод построения с использованием точки «А», которая раньше была поддержкой

для цены акции и точки 2, которая стала сопротивлением, мы с помощью методики построения «Хитрого канала», можем начертить поддержку, используя всего одну точку снизу. И эта точка 1.



На рисунке мы видим, что методом построения «Хитрого канала», используя, всего лишь одну точку 1, мы предугадали появление второй и третьей точек поддержки растущего тренда. В этом и есть смысл построения «Хитрого канала» – предугадывать расположение точек будущего тренда поддержки.

Построение каналов

Хитрый канал



Разберем классические сигналы в акциях Газпрома, на примере одного рабочего дня.

Разбор торгового дня в Газпроме 28.08.2014 года

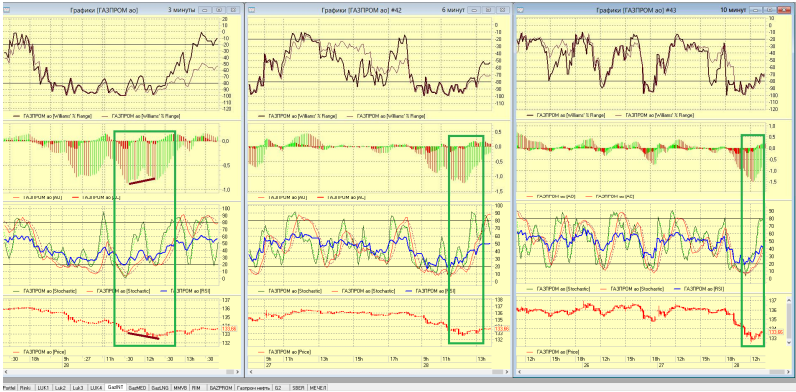


Рис.1. Сигнал «ИНТРА» в Газпроме с Сильными параметрами, четким переходом цвета, хорошей глубиной. На ТФ 3 минуты – присутствует Дивергенция.

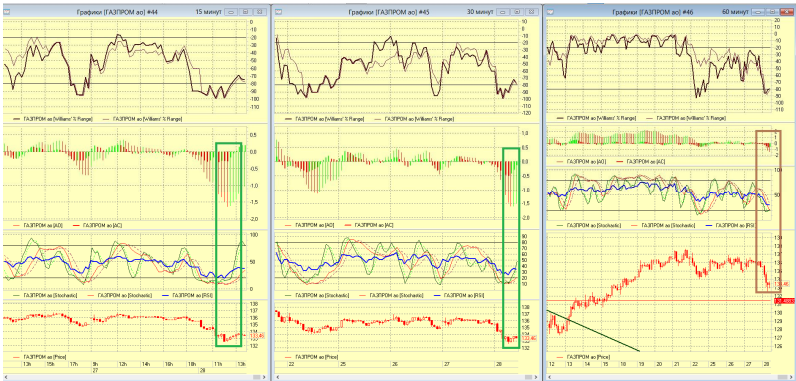


Рис.2. Сигнал так же подтвержден на ТФ 15 и 30.

Соответственно носит Характеристику Интра +15,+30.

Сигнал не подтвержден ТФ 60 мин, а также ИДЕТ против ТФ на 4 часа, на котором видно четкое движение вниз.

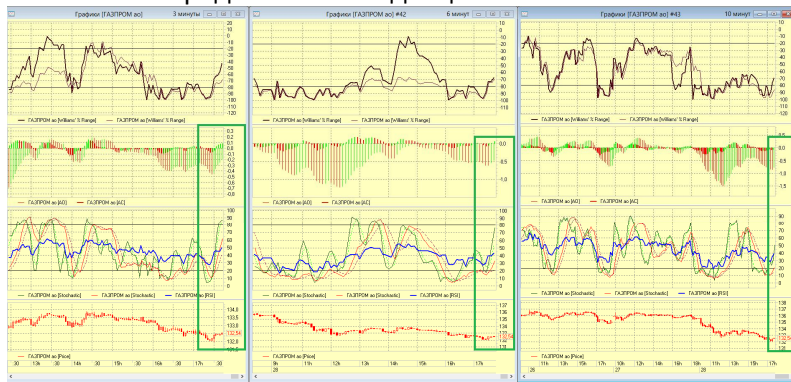
Соответственно внутри дня, указанный сигнал дал отскок +1,5 р., что достаточно Хорошо, с учетом падающего тренда на 4 часа.

Далее, снижение в цене акции продолжилось.



Рис.3. На ТФ ЧАС СНИЖЕНИЕ ПРОИСХОДИТ В РАМКАХ «Хитрого канала».

Далее, движение вниз останавливается на новом минимуме – сигналом «продолжения тенденции» на «Лонг».

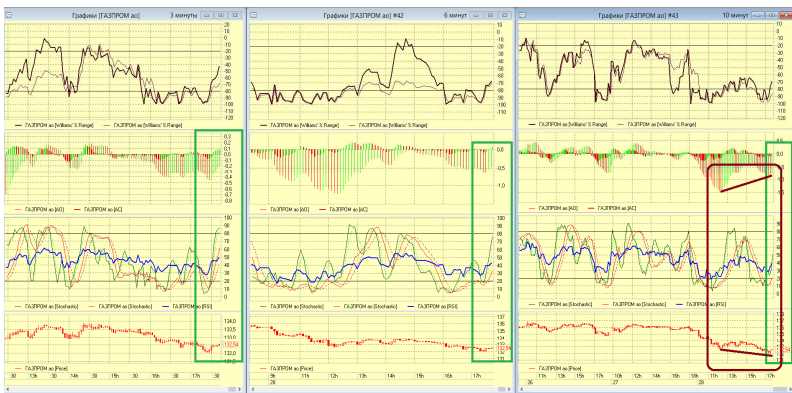


Сигнал продолжения тенденции

Рис.4. Сигнал продолжения тенденции на «Лонг».

Характерные признаки сигнала:

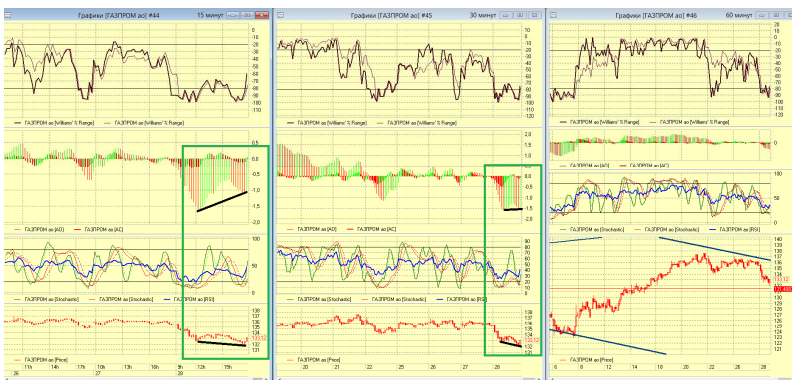
1. Глубина АО – меньше чем у основного сигнала в начале дня.
2. Дивергенции с малых ТФ – переходят на более крупные ТФ.



Сигнал продолжения тенденции

Дивергенция 10 мин.

Рис.5. ДИВЕР 10 мин.

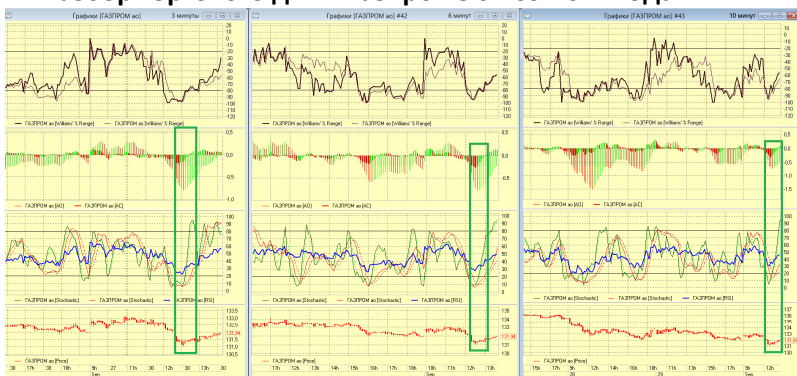


Дивергенции 15 и 30 минут, дают нам второй точный сигнал ВНУТРИ ДНЯ, на котором мы зарабатываем от 1 рубля и больше.

Рис.6. Второй четкий сигнал за день, это Сигнал «продолжения тенденции».

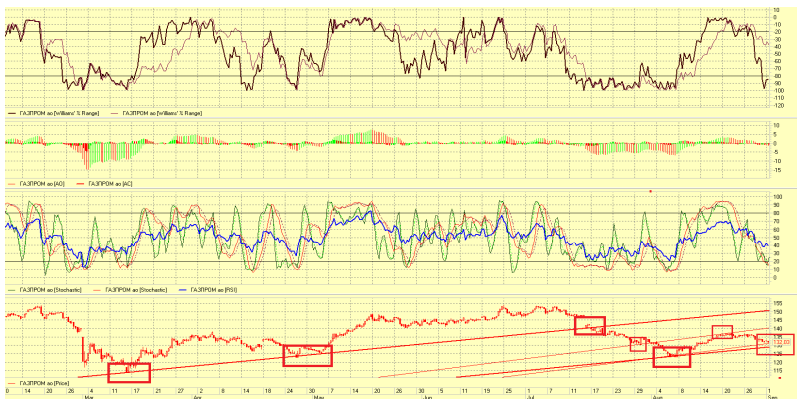
Вывод: Несмотря на меньшую глубину линий, из-за того, что сигнал перерос в дивергенции на более крупных ТФ, указанный сигнал не менее сильный, чем первый.

Разбор торгового дня в Газпроме 01.09.2014 года



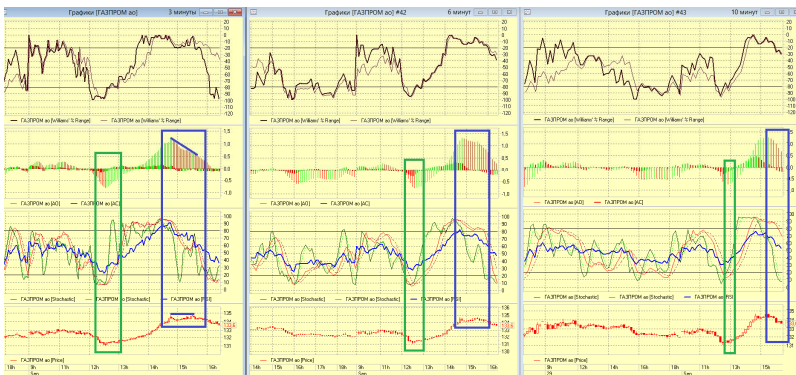
Сигнал ИНТРА с максимальной глубиной по АО.
Также хорошие показатели стохастиков от минимума.

Рис.1. Сигнал «ИНТРА» в Газпроме с МАКСИМАЛЬНОЙ ГЛУБИНОЙ АО, с четким переходом цвета, хорошей глубиной СТОХАСТИКОВ. Ждем, чтобы рынок хорошо отработал указанный сильный сигнал – РОСТОМ.



Хитрый, внутри Хитрого

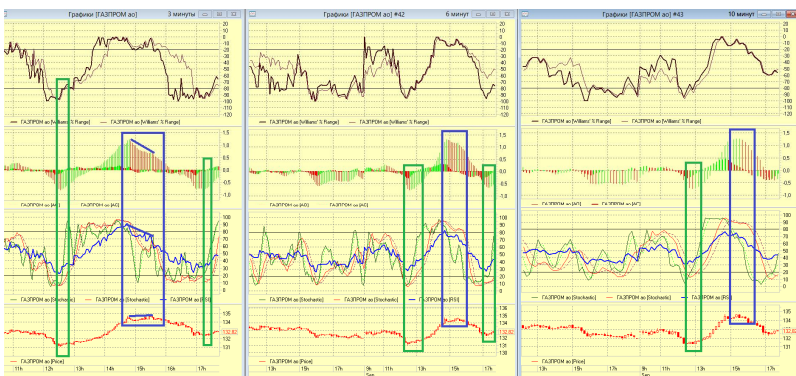
Рис.2. Сигнал так же сформировал локальный «Хитрый канал», внутри более глобального «Хитрого канала» на ТФ 4 часа. Вывод: Сильный сигнал по ВКЛАДКЕ ШАБЛОНА «ИНТРА».



ИНТРА Сильный с Максимальной Глубиной АО.

Интра Сильный с плоским диверсом по 3 мин.

Рис.3. «Лонг» и «ШОРТ», поступил Сильный сигнал на «ШОРТ» с Дивергенцией на 3 мин.

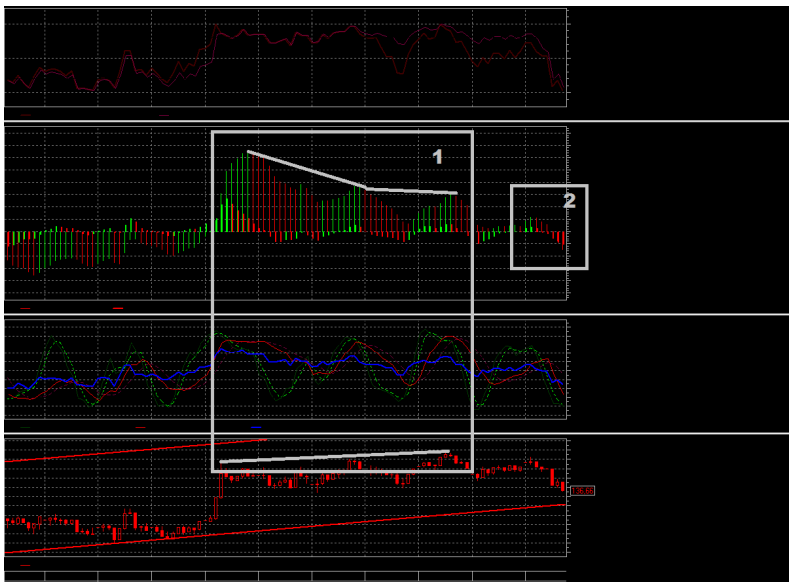


Сигнал с Максимальной Глубиной АО

Сигнал с Сильной высотой АОи дивергенцией на ТФ 3 мин

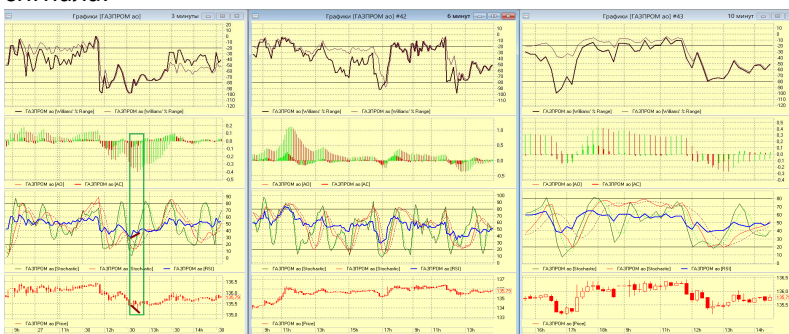
Сигнал с Максимальной глубиной АО (2)

Вывод: Хороший волатильный день с Чистыми сигналами.



- 1. Наш дивер на ТФ 60 мин, о котором снял ролик.**
- 2. На четвертую вершину дивергенции не дотянули, но вышли на сигнал продолжения тенденции.**

Дивергенции на любых «тайм-фрэймах» служат усилением сигнала:



Сигнал на вкладке ИНТРА в Газпроме от сегодня:

- 1. Короткий дивер на ТФ 3 мин.**

Глубины нет, по 6 мин и 10 мин по вкладке ИНТРА нет сильного подтверждение. Т.е. индикатор АО - не показывает ГЛУБИНУ, RSI не находится в зоне покупки.

Поэтому характеристика сигнала - СЛАБЫЙ, он и дал пока лишь полрубля.

Но, даже интрадейные сигналы, часто присутствуют либо слабые, либо их нет вообще.

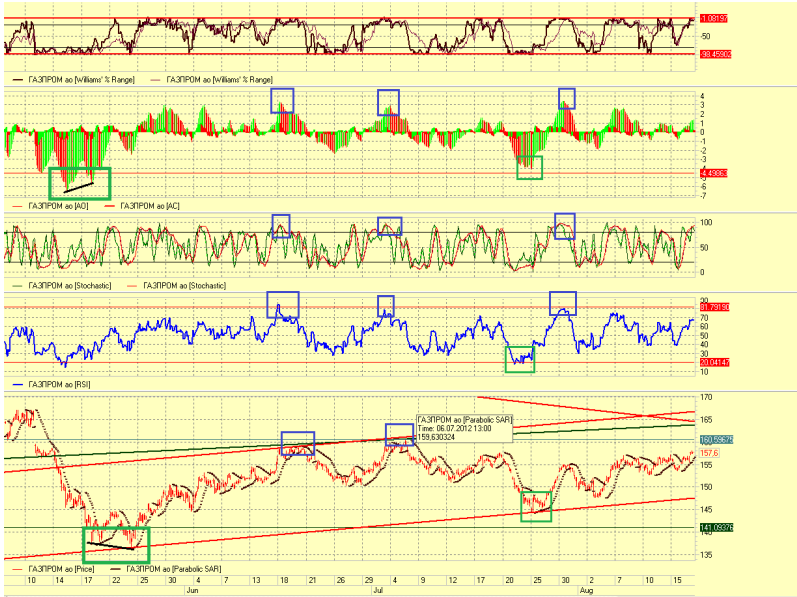
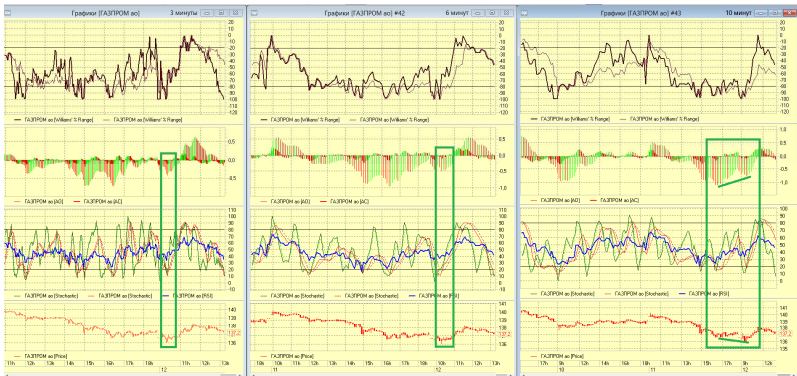


Рис. Сильная дивергенция



Дивергенция 10 мин, ГАЗПРОМ

Сигнал дал + 2 рубля внутри дня.

Рис. Дивергенция на «тайм-фрейме» 10 мин.

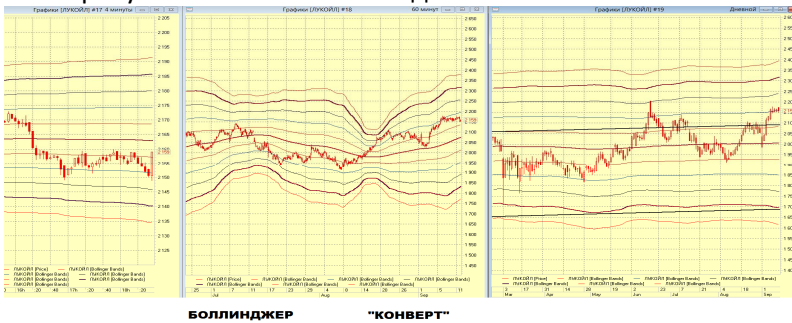
Глава 11 «Боллинджер»,

как вспомогательная часть системы

Чтобы усовершенствовать торговлю, можно задать ограничительные рамки хода для любого инструмента.

Мы воспользовались индикатором «Боллинджера» и настроили на его основе «КОНВЕРТ», с параметрами отклонения 1,2,3,4,5 и периодом 233.

На рисунке «КОНВЕРТ» выглядит так:



Далее рассмотрим примеры самых сильных сигналов по «КОНВЕРТУ».

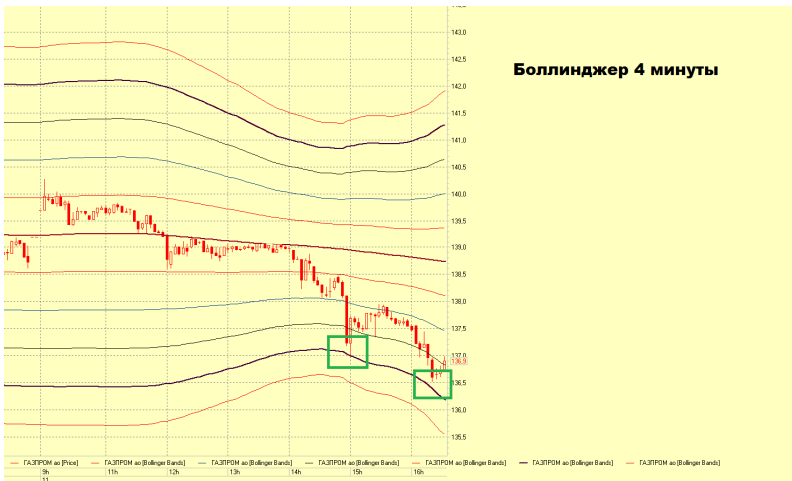


Рис.1. Первый из сигналов – достижение ценой 4-го уровня.

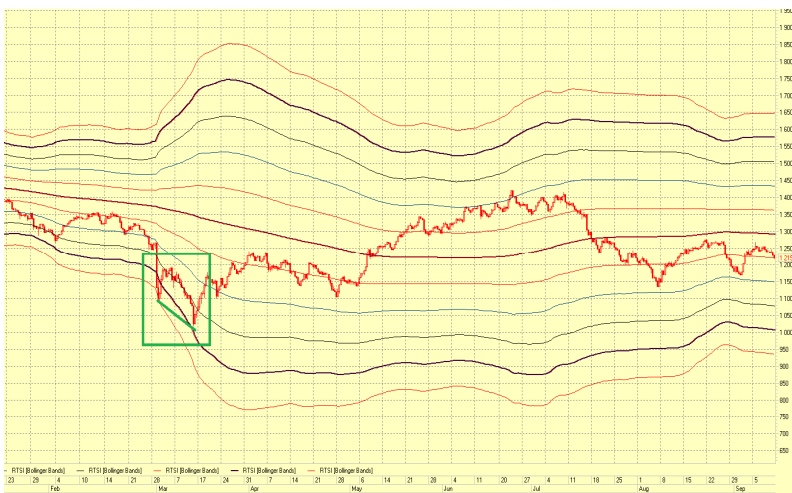
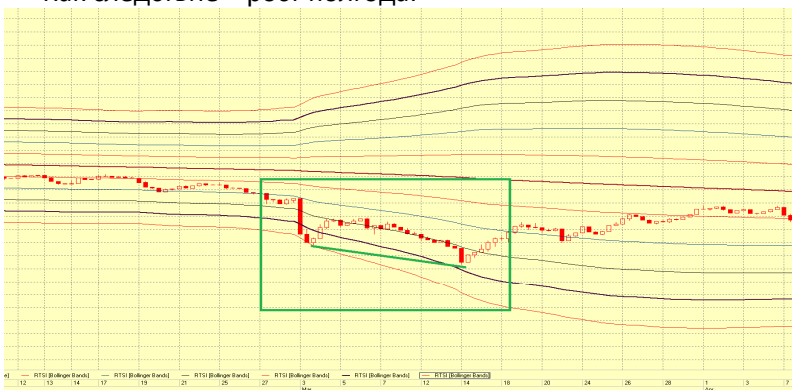


Рис.2 Дивергенция по «Боллинджеру».

Это когда цена ушла ниже, но ловит ее не последняя линия конверта, а уже –предпоследняя.

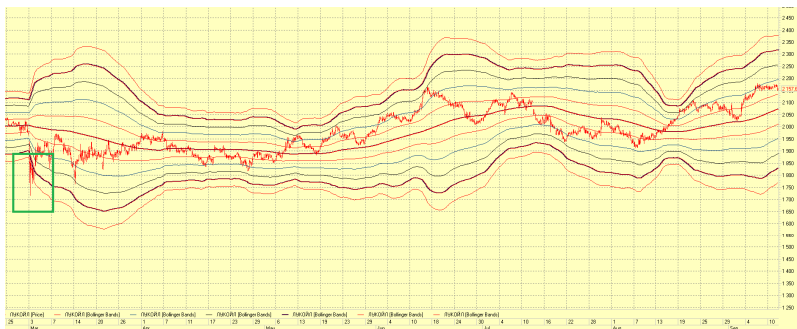
Как следствие – рост полгода.



Дивергенция на ЛОНГ, по Боллинджеру.

Это когда Значение цены НИЖЕ, но она опирается уже не в последнюю линию Боллинджера, а в предпоследнюю - широкую.

Увеличим рисунок:
Рис.3.



Самый Сильный и редкий сигнал, выпадение за КОНВЕРТ.

Дает рост на полгода.

Рис.4. Самый сильный сигнал по «Боллинджеру».



Сильное сужение линий Боллинджера, говорит о том, что нас ждет СИЛЬНОЕ ДВИЖЕНИЕ.

**Дивергенция по Боллинджеру с выходом за границы конверта.
Как следствие СИЛЬНЫЙ и ДОЛГИЙ РОСТ.**

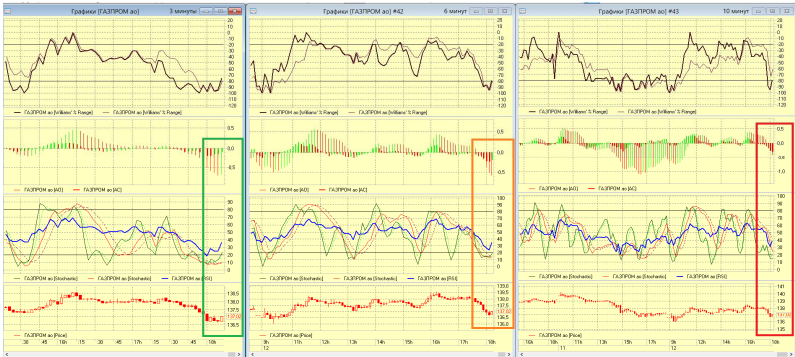
Рис.5. Виды сигналов на «Боллинджере».

Глава 12

Накопление силы сигнала на «Лонг» и «Шорт»

Начнем рассматривать тему накопление силы сигнала «онлайн», путем последовательного объяснения этапов формирования сигнала.

Этап первый. Формируется сигнал на вкладке «Шаблона ИНТРА» от тайм-фрейма 3 минуты.



Зреет сигнал Средней силы (по глубине индикатора АО).

Вкладка ИНТРА.



Газпром, Сигнал по ИНТРА, средней силы (средняя глубина АО).
Сигнал усиливает Дивергенция на тайм-фрейме 3 мин.

Предыдущий слабый сигнал по ИНТРА, дал +1,5 р. профита.



После того, как сигнал полностью сформировался на вкладке «Шаблона ИНТРА», он начинает свое формирование на следующей вкладке «МЕДИУМ». На тот момент как во вкладке «МЕДИУМ» сигнал полностью будет сформирован, то на вкладке «ИНТРА» (согласно тому, что там расположились бо-

лее короткие тайм-фреймы) «кодовый замок», уже провернется несколько раз. В тот, момент, когда мы увидим во вкладке «МЕДИУМ» сильный сформировавшийся сигнал, то во вкладке «ИНТРА» будет новый сильный сигнал, который можно обозначить как «Сигнал продолжения тенденции».

В нашем случае, указанный очередной сигнал «кодового замка» на «Интра» сформировался в виде дивергенций на всех тайм-фреймах и движение будет продолжено именно по праву сигнала «продолжения тенденции».

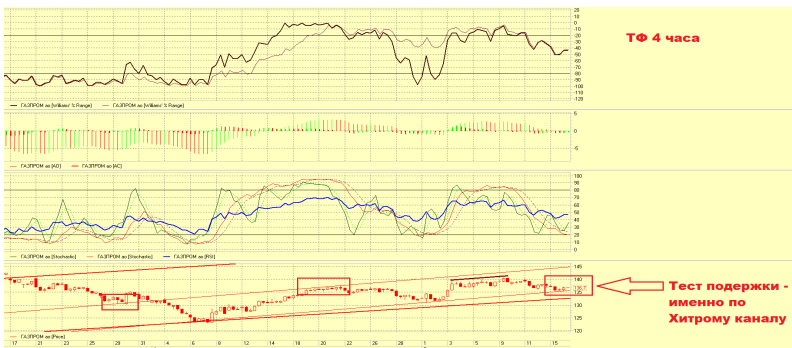


Дивергенции ИНТРА

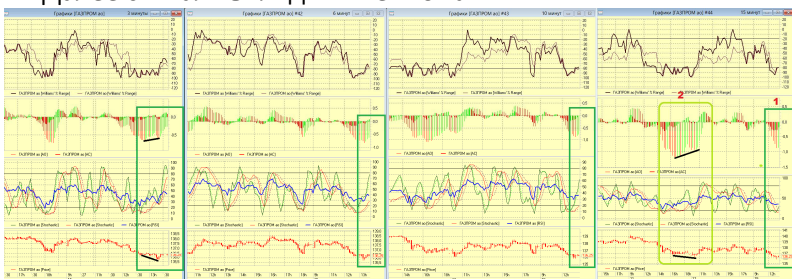
Ниже видим, что в указанный момент происходит на вкладке Шаблона «МЕДИУМ»:



Сигнал формировался и сформировался до Медимум с дивергенциями на 15 и 30 минутах.



Далее сигнал выглядит именно так:



- 1 Видим добавление зеленой полоски на ТФ 15 мин., по индикатору АО. Сигнал стал называться ИНТРА +15. Глубина АО, в категории "ниже среднего".
- 2 Как, видим два дня назад, был по 15 минуткам сигнал на Лонг, категории "Выше среднего", с дивергенцией на 15 мин. Указанный сигнал, отмечен нами для сравнения Силы сигнала.

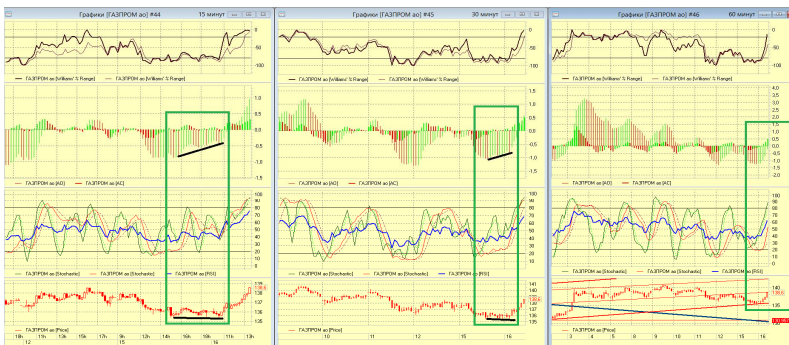
После чего происходит дальнейшее формирование Силы сигнала:



Возникла ИНТРА +15, +30 с Дивергенцией на ИНТРА в смысле Средней силы на 15 и 30 мин тайм-фрейме



И как итог, мы видим результат формирования Сильного сигнала ИНТРА + МЕДИУМ:



Медиум - Результат, Рост по нашему Сигналу.

После того, как акция выстрелит по лонговому сигналу вверх, начинается накопительный процесс на силу сигнала в обратном направлении.

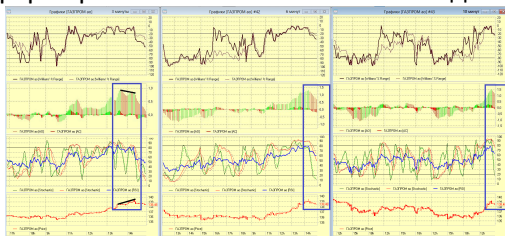
Сначала это явление можно наблюдать так же на малых тайм-фреймах во вкладке ИНТРА:



Зреет ШОРТ по ИНТРА, на 3 мин - есть дивергенция.



Сигнал сформировался на 3 мин. Тайм-фрейме, начинается формирование сигнала на всей вкладке ИНТРА:

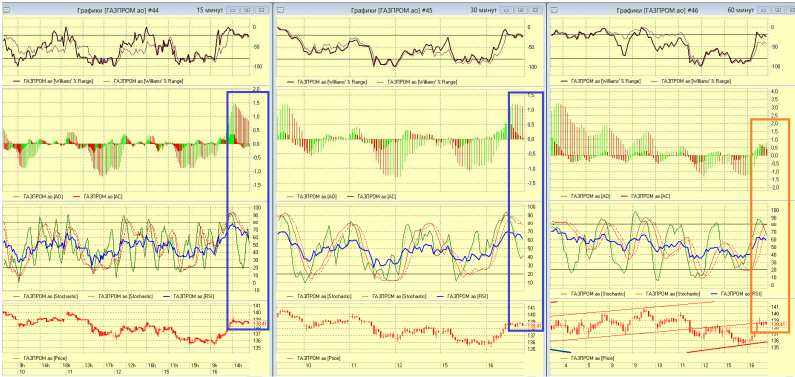


Сигнал сформировался на всей вкладке Шаблона ИНТРА



Сигнал полностью сформирован на ИНТРА, ждем сигнал ИНТРА +15 и Интра +15, +30.

И естественно, получаем указанный сигнал:

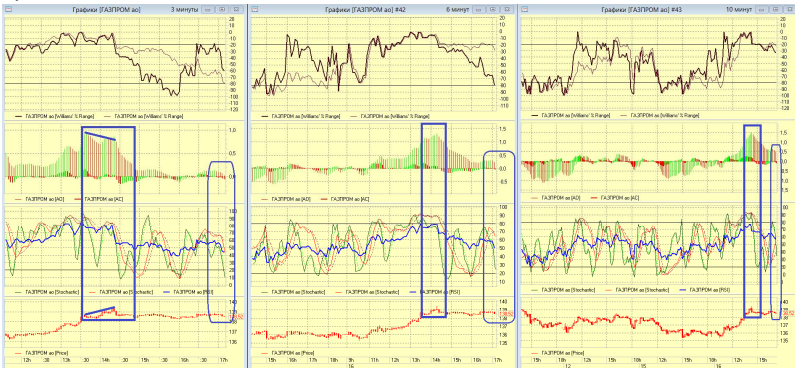


Вкладка Медиум сигнал на 15 и 30 мин.

Категория сигнала - ИНТРА +15, +30.

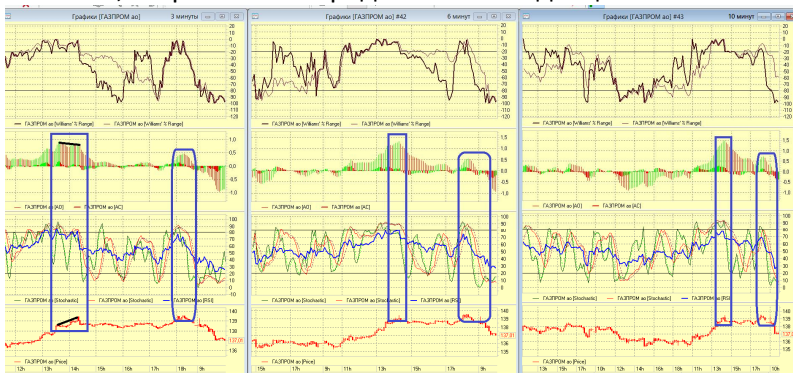
После того, как указанный сигнал сформирован, ждем ИНТРА + МЕДИУМ на ШОРТ и сильный сигнал продолжения тенденции на вкладке ИНТРА.


И получаем, сначала первый сигнал «продолжения тенденции на ШОРТ»:



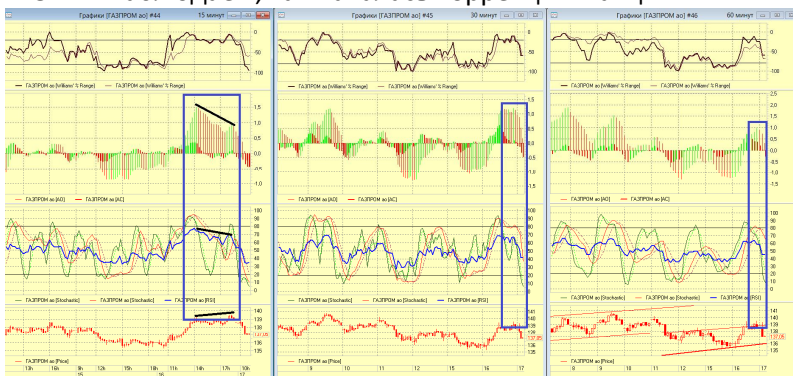
Сигнал продолжения тенденции на шорт

Затем, второй сигнал продолжения тенденции на ШОРТ:



 ИНТРА - формируется второй сигнал "продолжения тенденции"

После чего, закономерно получаем ИНТРА + МЕДИУМ на ШОРТ и наблюдаем, как началась коррекция в акции:



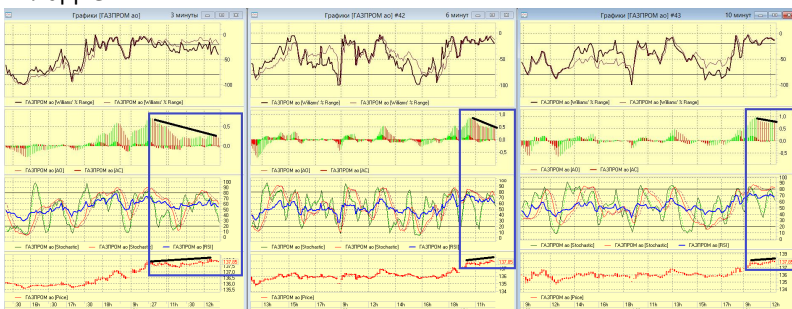
Во вкладке Интра, у нас уже второй сигнал, как сигнал продолжения тенденции,

а в текущей вкладке Шаблона МЕДИУМ - дивергенция на 15 мин.

Сигнал ИНТРА + МЕДИУМ - Сильный, как следствие коррекция в акции.

Указанная методика, использующая сигналы категории ИНТРА + МЕДИУМ по силе Выше средних значений, позволяет нам взять + 4-5 рублей прибыли от Лонга, и очень точно выйти из позиции или даже играть краткосрочно и получить более 2 рублей отката.

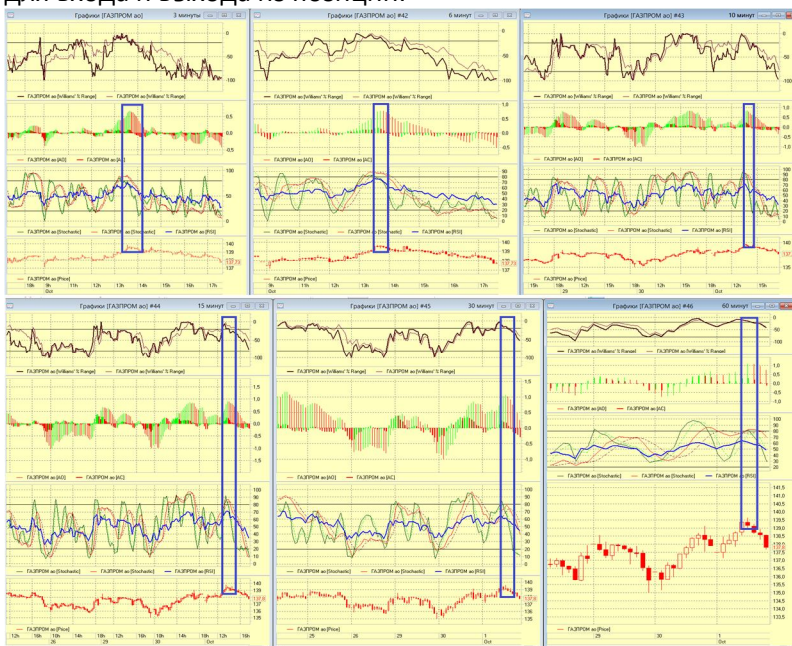
Далее рассмотрим пример, тройной дивергенции на вкладке ИНТРА:



Тройная дивергенция на вкладке ИНТРА

Далее ИНТРА + МЕДИУМ, когда идеально точно, совпадают 6 тайм-фреймов на двух вкладках ШАБЛОНА:

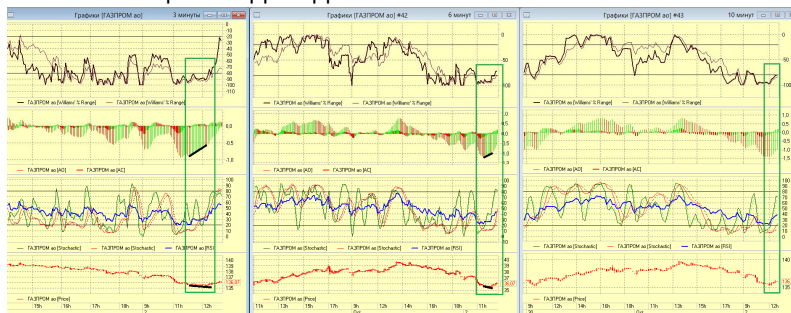
Для трейдера, который используют среднесрочную систему в торговле, ИНТРА + МЕДИУМ, считается основным сигналом, для входа и выхода из позиции.



ИНТРА + МЕДИУМ ШОРТ

Далее рассмотрим, как снижалась цена акции, после указанного сигнала.

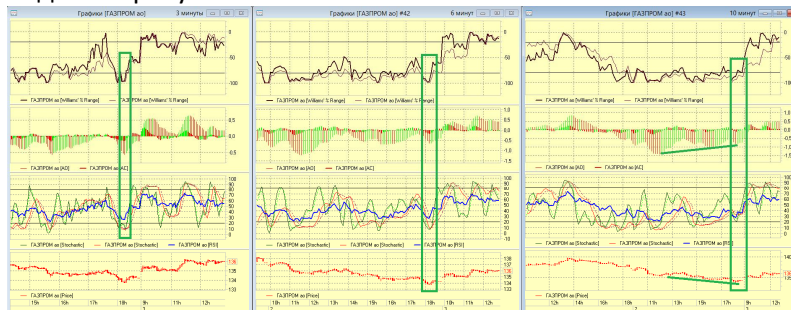
Сначала цена падает до классического сигнала ИНТРА:



Указанный сигнал имеет даже дивергенцию на 3 минутах, можем расценить его как первичный сигнал средней силы для интрадейной торговли.

Далее следует небольшой отскок и снижение продолжается снова.

Начинается процесс накопления силы сигнала, который мы видим на рисунке ниже:



На тайм-фрейме 10 мин, прослеживалось накопление силы сигнала в виде длинной тройной дивергенции.

После чего уже вырезает сильный сигнал на вкладке Шаблона МЕДИУМ:



**МЕДИУМ, Тройной дивер по 15 минуткам.
Сигнал ИНТРА + МЕДИУМ - ЛОНГ**

После чего, мы уже наблюдаем резкий рост в несколько рублей.

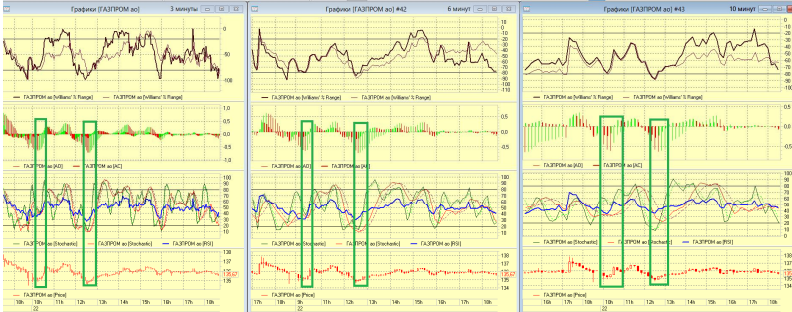
В этом месте, действие сигнала на ШОРТ от 139 рублей, по категории ИНТРА + МЕДИУМ, который мы рассматривали – заканчивается. Так как мы видим зеркальный сигнал категории ИНТРА + МЕДИУМ на ЛОНГ. Снижение составило 6 рублей, что для двух торговых сессий считается хорошим профитом (прибылью).

Глава 13

Сложение силы сигнала внутри дня

Самый распространённый вариант сигнала, это сложение силы сигнала по мере выпадения различных вариантов сигнала.

На примере рассмотрим, сложение обычных двух сигналов категории ИНТРА +15, +30

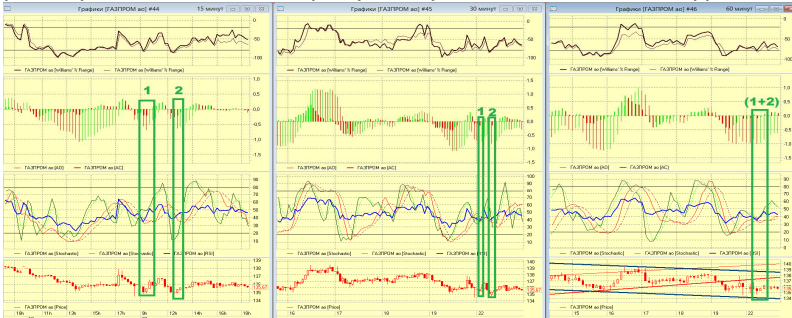


Торговый день дал 2 сигнала ИНТРА, которые дали по + 2 р.

При цене ГП 135 это хорошая доходность

На рисунке видим два отдельных сигнала ИНТРА, которые каждый дал хорошую доходность внутри дня.

Но, второй сигнал был сильнее, не только по параметрам глубины линий и прочим критериям Шаблона, но еще включилось в работу дополнительное правило сложение силы сигнала и правило расширение сигнала в сторону следующего по силе тайм-фрейма:



Оба сигнала были категории ИНТРА +15, +30....которые сформировались во втором случае в Сигнал ИНТРА + МЕДИУМ.

Глава 14

Мечел, хороший наглядный пример для изучения теории

Стоил 30 рублей два дня назад, упал до 20, потеря 33%.

Кто вложил 100 тыс., потерял 33 тыс. рублей.

При возврате обратно, те, кто вложат еще 100 тыс. рублей по цене 20 рублей, получают плюс 50 тыс. рублей, или + 50% на вторую вложенную сотню.

Т.е. наглядно видим, что падая на 10 рублей это 33% падения, а рост на 10 рублей, это 50% роста. Поэтому, кто – то купив по тактике усреднения, ещё на 100 тысяч считает (таких по опросам 90%), что средняя цена его акций 25 рублей. Он считает, что нужно поделить вложенные деньги пополам, думая, что есть пакет на 100 тысяч по 30 и есть пакет на 100 тысяч по 20, а середина между ними 25. Раз деньги пополам, то и цену пополам.

И такой трейдер считает, что получит при возврате ровно 5 рублей прибыли.

*****Заблуждение трейдеров, понять просто, они привыкли покупать лотами или акциями.**

Покупать 1000 лотов и покупать при падении еще 1000 лотов, поэтому в их подсознание крепко вбивается, что средняя цена будет 25.

Мы же приводим пример усреднения, когда покупается на сумму в рублях, а не лотами. Т.е. купили на 100.000 рублей и еще раз на 100.000 рублей.

Но, мы знаем, что должно получиться 50 тысяч в плюс со второго пакета акций, а минус 33 тысячи убытка – просто исчезнут из того пакета.

И тогда будет не 50 тысяч за минусом 33 тысячи убытка, т.е. всего 17 тысяч прибыли, а будет только плюс 50 тысяч прибыли от нового пакета, старый выйдет полностью в ноль по прибыли.

Проверим.

100 тысяч делим на 30 получаем 3.333 акций.

Мы покупаем ещё по цене 20 на 100 тысяч, это 5.000 акций.

Итого у нас 8.333 акции по 25 рублей средняя.

Должно быть 5 рублей прибыли.

Получается прибыль 41.665 рублей.

Но ведь мы знаем, что ПРИБЫЛЬ БУДЕТ 50 тысяч, а не 41,665...

Вот и вопрос, а куда делись эти 8.335 рублей ?

Ответ простой, купив на 100 тысяч по 30, потом на 100 тысяч по 20....мы НЕ получаем среднюю цену 25 рублей.

Вот такие вот банальные, простые – арифметические расчеты.

Нужно на самом деле 200 тысяч поделить на количество акций 8333 и это будет точная средняя, и она будет 24 рубля.

Соответственно, что мы имеем.

Возьмем всю величину падения с 30 до 20 рублей, и обозначим термином Величина падения. Установим величину падения – равной 100%.

Получаем:

Если на падении, добавляться равными суммами, то средняя цена (при падении, смещается вниз в соотношении 4/6 (если падение составило 33%). Но, не 50/50, как принято считать у 90% необразованных трейдеров, далеких от арифметики.

Если установим другую величину – Величина отскока от цены 20 до цены 30, и дадим ей термин Величина отскока равная 100%, то увидим, что для того, чтобы вернуться к средней цене 24 рубля, нам после падения 33% нужно вырасти всего на 20%.

Поэтому, заблуждаются все, кто обвиняют тактику усреднения и считает, что у ее приверженцев, ну «очень высокая средняя цена пакета».

Далее, тактика «Разрыв при резком падении».

Проверка

100.000 рублей по 40 р. – 2500 акций

100.000 рублей по 20 р. – 5000 акций

200.000 делим на 7500 акций = 26,66 руб.

Видим, что соотношение уже не 4 к 6, как при падении на 33%, при падении на 50% соотношение равно – 6,66 к 13,34.

Возвращаемся к терминам Величина падения равная 100% и Величина отскока равная 100%.

Чтобы от 20 рублей, вырасти до 26,66 нам нужен рост всего 33,3%

$20 + 33,3\% = 26,66$ р.

Это конечно, больше 20% роста, чем в первом случае при падении от 30 до 20, но тут и величина падения намного больше, а именно 50% против 33% в первом случае.

Итак, нам нужна наглядная зависимость усреднения, отскока и падения.

Третий пример:

100.000 рублей по 100 р. – 1000 акций

100.000 рублей по 10 р. – 10.000 акций

200.000 рублей / 11.000 акций = 18,8 рублей.

Выводы.

Да при таком раскладе от текущей цены нужно вырасти на 88% .

Но, если применить наши термины и взять всю величину падения за 100%, то соотношение будет 8,8 к 81,2 т.е. в 9,22 раза меньше.

Назовем число 9,22 – коэффициентом усреднения позиции, при разрыве падения.

Итак, при падении на 90%, коэффициент усреднения позиции резко растет.

Соответственно, никаких высоких цен, средних пакетов, при усреднении – быть просто не может математически, раз при «разрыве, при резком падении» соотношение увеличивается в

арифметической прогрессии, и при падении в 90% соотношение имеет коэффициент аж 9,22.

Что же такое 9,22???

Это Ваша средняя цена стала в 9,22 раза лучше, чем была при первом входе.

Соответственно, это коэффициент – улучшения средней цены по Вашей позиции.

И чем разрыв больше, чем коэффициент улучшения позиции – Выше.

Лучше чем стоп приказы? Однако – да.

Т.е. фактически, мы видим, что лучше усредняться. И чем резче идет против Вас рынок, тем больше выгоды от усреднения. Тем выше коэффициент усреднения, тем Лучше эффект от усреднения.

Фактически, пусть падает чем дальше, тем лучше.

Мы видим, что при 90% падении, т.е. падении в 10 раз коэффициент новой покупки на ту же сумму, улучшает Вашу позицию в 9,22 раза.

Я писал все это и многое другое, много лет назад в серии статей – Биржевой парадокс.

Глава 15 Работа системы «Шаблон»

Берем ГАЗПРОМ на непрерываемом участке движения акции.
Для удобства отображения работы системы, взяли ТФ 15 мин.
Условия:

1. Берем сигналы от «Интра +15» и сильнее, категории сред-ней и сильный, либо ИНТРА, категория сильный с максимальной глубиной АО либо с Дивергенциями.

2. Сигналы берем все подряд, на шорт и на лонг.

Действия:

1. После того, как сигнал сработал, ставим две цели +1,5 р. фикс половины позиции, при подходе к цене входа фикс, либо фикс второй цели + 2 р. (фикс 50% от остатка) и фикс третьей цели при + 3 рубля. Либо можно ограничиться двумя выходами +1,5 р. и + 3 р.

2. Стоп-приказ 1 рубль.

3. Вход после того как сигнал сформировался, но только от КРУГЛОГО числа!

Смотрим на графиках результат, подряд было 31 сигнал обозначенных нами категорий.

ВСЕ СИГНАЛЫ СРАБОТАЛИ, Дали минимум +1,5 р., большинство исполнили третью цель + 3 рубля. Система не допустила одной ошибки.

Схема 1.

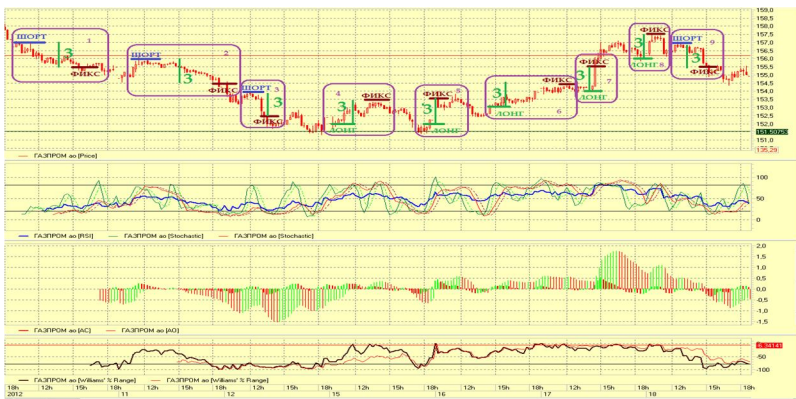


Схема 2.

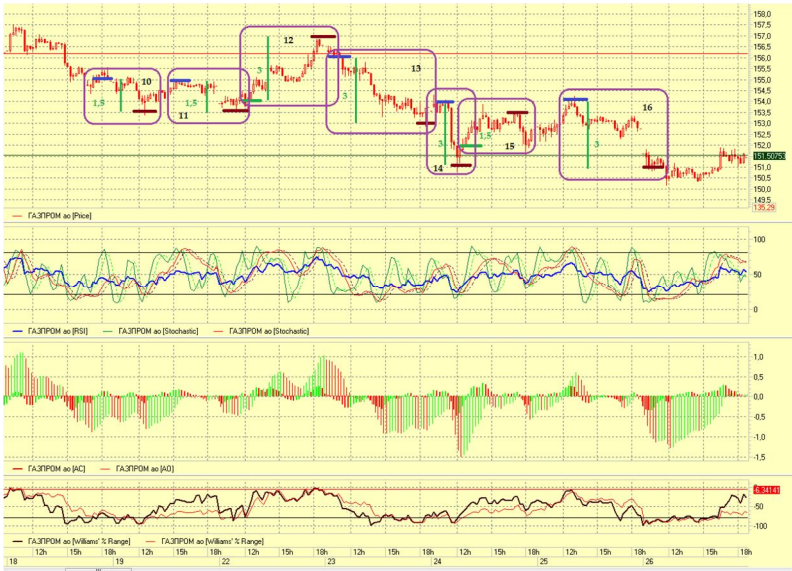


Схема 3.

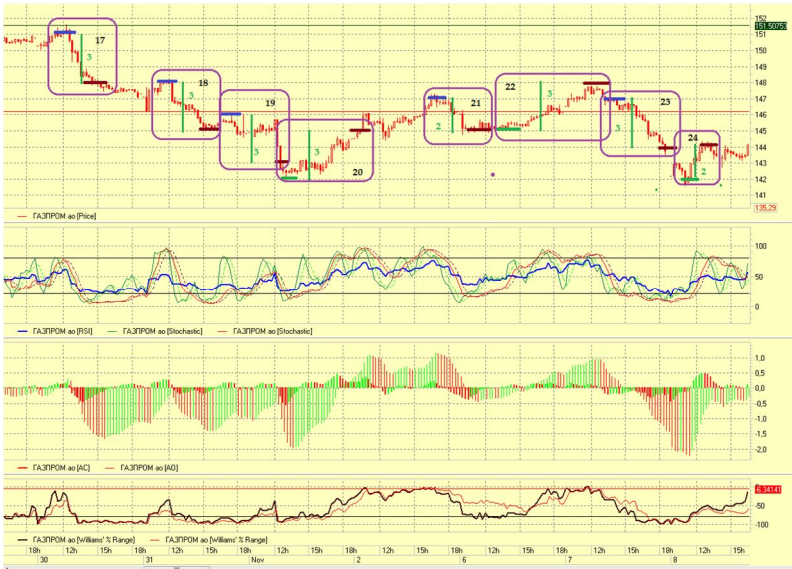


Схема 4.



Глава 16 «Секреты управляющего»

Пока рынок падает, расскажу Вам один маленький секретик, из таких, секретиков, которые даже я не публикую, даже на своем сайте. Расскажу его Вам, как маленький мастер-класс.



Газпром и Газпромнефть.

Секреты Управляющего.

Как взять дивиденды так, чтобы тебе за это ничего не было.

ПРИМЕР. Лонг под Дивы, против "шорта" напарника.

Как взять быстро дивиденды, так, чтобы тебе за это ничего не было.

Есть способ.

Берем две акции Спутника -у нас это акции, графики которых одинаковы.

Газпром и Газпромнефть.

Имеют схожую цену, но, они имеют дивидендную отсечку в разные даты, разброс месяц.

Дивиденды по 8%, берем в июне, скажем на одну часть Лонг Газпромнефти, а на вторую Шорт Газпрома, два дня проходит и половина от 8% – в кармане.

Так, как то, что упадет в Газпроме, нам покроет – вторая часть, которую мы вложили в падение в Газпромнефти.

Через месяц делаем НАОБОРОТ – Лонг Газпрома и Шорт Гапромнефти.

Потом через два дня кроем по одной цене, суммарно получается за месяц, мы получим около 8% прибыли в виде дивидендов на весь наш депозит.

Если дальше продолжать искать ПАРЫ СПУТНИКИ с отсечками в Разное время, то можно, с каждой такой пары, получить Половину дивидендов за два дня, ничего не теряя.

Если же вдруг, они обе вырастут, то Вы так же получите свои дивиденды.

Если же не хотите связываться с дивидендами, то в момент отсечки в Газпроме – шортите акцию Спутник, а именно Газпромнефть. Соответственно, она упадет в след за Газпромом, но вам не придётся возвращать удержанную сумму дивидендов, как если бы вы шортили Газпром перед отсечкой.

Глава 17

Позиционная торговля

Из предыдущих глав, мы увидели, что можем достаточно точно определять развороты в ценах акций. Для того, чтобы этим знанием воспользоваться, нужно ввести в свою торговлю еще несколько понятий.

Уровни цены.

Уровни цены могут быть «шортовые» и «лонговые». Это своеобразный коридор, который мы задаем в цене акции. Соответственно, чем дольше указанный коридор, тем глобальнее уровни. Если в своей торговле, мы не используем операцию «шорт», то уровни у нас будут «выхода из позиции» и «входа в позицию».

Стоит отметить, что если трехгодовой интервал нам даст достаточно серьезные и глобальные уровни для торговли, то скажем десятилетний коридор уже будет не так актуален и не сильно поможет нам в торговле по простой причине, рынки меняются быстро. Сильно устаревшая история цен, нам, скорее всего, не пригодится в работе. Поэтому, достаточно смотреть изменение цены акции за последние пять – семь лет.

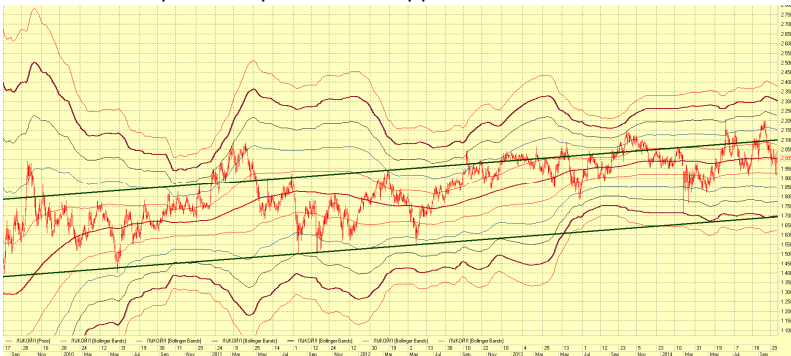


Рис. Акция Лукойл, интервал 5 лет.

Для примера мы взяли цену акции Лукойла за последние 5 лет. Как видим, пять лет акция движется в зажатых рамках.

Соответственно, для нее глобальные уровни «входа в позицию» и «выхода из позиции» – определить не сложно.

Этим и отличаются акции первого эшелона, которые мы рекомендуем вам торговать, раз уж вы решитесь на этот шаг.

Выбирайте те акции, которые наиболее легки в анализе цены за последние 3-5 или может быть даже семь лет.

Как видим из рисунка, за 5 лет, акция была 5 раз в зоне покупки и примерно 6 раз в зоне выхода из позиции. В соответствии из указанного характера движения цены акции, вам нужно сформировать свою стратегию.

Уровни формирования позиции.

Исходя из того, что глобальные уровни цены нам видны заранее, нам нужно подходить к формированию позиции исходя из них.

Правильнее нужно разбить интервал изменения цены на уровни. Для примера возьмем семь уровней цены в Лукойле:

1950

1850

1750

1650

1550

1450

1350

Начинайте формировать свою Лонговую позицию от получения сильного сигнала на Лонг по системе Шаблон и если вы ошибетесь, то оставите пакет акций с входом 1850 и целью 2050. Войдите на этом сигнале на 20% от вашего депозита и ждите дальнейшего изменения цены.

В случае если вы вошли правильно, то при росте вы частями зафиксируете прибыль. Если снижение продолжится, то вы «лонговую» позицию постепенно, усиливая силы входа, купив второй раз на 30% депозита, а третий раз на 50% депозита. Вы можете рассчитать свою стратегию на 3 или 5 или 7 входов.

Но, нужно понимать, что в зависимости от того, сколько рабочих «уровней коридоров» вы займете пакетами акций, то

только от этого и будет зависеть полученная вами прибыль. Ведь если акция задержится на одном или трех уровнях на пару лет и вы сделаете на этих уровнях пару сотен сделок продавая и заново откупая ваши «уровневые пакеты», то ваша доходность будет просто астрономическая.

Рассчитаем на примере Лукойла, конкретный пример по системе и стратегии с минимальным риском:

Годовая торговля. Разработано Seven_17.

На примере ЛУКОЙЛА об. СХЕМА (практик).

Схема более Долгосрочная, чем Среднесрочная.

Свойства схемы.

А) Схема представляет собой пример работы с портфелем минимального риска.

Б) При работе со схемой – абсолютно не используются «стоп-заявки». Подход математического входа в позицию – игнорируется.

В) Фиксируются – только «профитные» сделки в момент получения запланированной прибыли. Никогда не фиксируется убыток.

Правила использования.

1. Четко соблюдать вход в позицию согласно заранее распisanного плана торговли. Никогда не отступать от Плана торгов.

2. Правильное и четкое распределение имеющихся на депозите денежных средств.

3. Страховка рисков «депозитом поддержки».

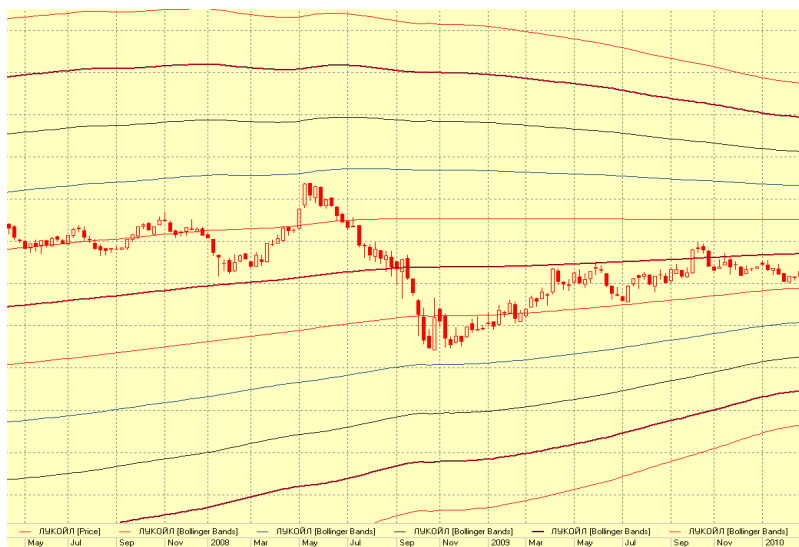
4. Работа только от Лонга.

5. Предварительный 7-ми летний анализ, выбранной для работы Акции.

6. Мы используем максимальное плечо $\frac{1}{2}$. (0,95% от депозита).

Указанная схема, как и «Правило математического входа», основана лишь на математике и банальной статистике.

На первом рисунке мы разлиновали выбранную нами котировку на графике за последние 7 лет.

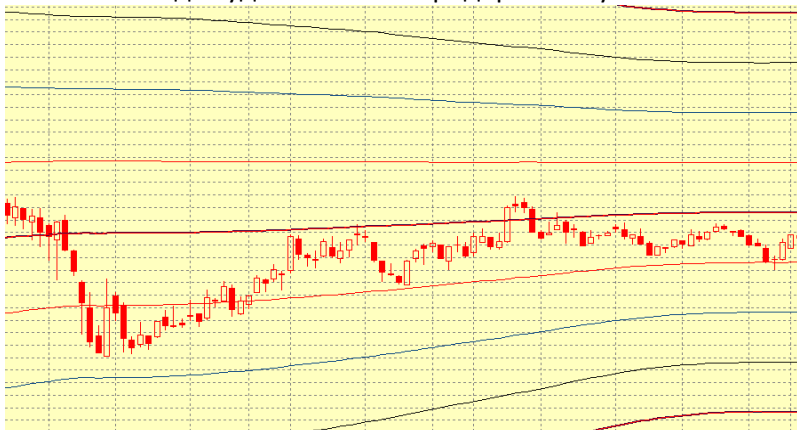


На рисунке мы видим данные на 2009 год.

Мы наглядно видим, выше какого уровня мы продадим все, что будет у нас куплено с огромной прибылью. Это выше Толстой Красной Линии.

При этом мы в синие цвета и синие оттенки – густо разлиновали самый торгуемый в настоящее время коридор. Он самый движущийся и самый волатильный. Перемещения между границами происходят довольно быстро.

Увеличим для удобства этот коридор на Рисунке 2.



1550 – это выбранный нами начальный уровень №1. Средняя синяя линия.

Начинаем расчет схемы. При уровне №1 мы покупаем на 10% доступного нам депозита и не ставим «стоп-приказ».

В зависимости от собственного настроения играем в коридоре 1550-1750, продавая и откупая акцию снова. Глобального влияния на наш депозит – абсолютно никакого. Схема – выходим частями выше уровня 1650, а обратно входим частями ниже уровня 1550.

ПРИМЕР (расчет): Если все время двигаться в указанном коридоре.

1000 000 = 100% нашего депозита.

Купили на 10%, т.е. купили на 100 тысяч по 1550, продали по 1650 (в среднем).

Получили 6451 руб. прибыли. От суммы покупки это, 6,45%, а от депозита 0,645%. Исходя из нашего графика, если мы за год никуда не двинемся, то такая ситуация произойдет раз 7.

Т.е. мы получаем около 4,5% годовых уже даже используя лишь 10% от нашего депозита.

Но как мы сами понимаем – такого быть не может, и мы обязательно двинемся в ту или иную сторону, причем значительно сильнее указанного нами коридора.

Если мы двинемся вверх – значит мы выбрали не ту акцию. Смотрим снова, перечерчиваем коридоры.

Просто передвигаем увиденные линии выше.

Если мы двигаемся вниз – расширяя боковое движения, тем самым расширяя рамки для торговли. То ниже голубой линии, мы покупаем еще на 15%, скажем, купили мы в среднем по 1400 руб.

Купили на 15%, т.е. купили на 150 тысяч по 1400, продали снова по 1600 (в среднем).

Получили 21428 руб. прибыли. От суммы покупки это – 14,28%, а от депозита 2,14%.

Исходя из нашего графика, если мы за год никуда не двинемся уже из новых рамок, то такая ситуация произойдет раз 5 (мы всегда берем минимум, в реальности повторится гораздо

большее количество раз).

Т.е. мы получаем около $10,5\% + 4,5\%$ (полученных ранее) = 15% годовых уже даже используя лишь 25% от нашего депозита.

Далее становится более интересно.

Две зеленые линии 1300 и 1100, тут мы берем два раза по 25% . Т.е. используем 75% своего депозита.

Купили первый раз на 25% , т.е. купили на 250 тысяч по 1300, продали уже по 1500 (в среднем).

Получили 38461 руб. прибыли. От суммы покупки это – $15,38\%$, а от депозита $3,84\%$. Исходя из нашего графика, если мы за год никуда не двинемся уже из этих новых рамок, то такая ситуация произойдет минимум раз 5 (мы всегда берем минимум, в реальности повторится гораздо большее количество раз).

Т.е. мы получаем около 15% (полученных ранее) + $19\% = 34\%$ годовых уже даже используя лишь 50% от нашего депозита.

Уровень 1100.

Купили второй раз на 25% , т.е. купили на 250 тысяч по 1100, продали уже по 1400 (в среднем).

Получили 68181 руб. прибыли. От суммы покупки это – $27,27\%$, а от депозита $6,81\%$. Исходя из нашего графика, то такая ситуация произойдет минимум 3 раза (мы всегда берем минимум, но тут уменьшили дальше просто некуда, увеличить и это можно легко, мы рассчитываем при продаже по 1400, а можно поставить 1600).

Т.е. мы получаем около 34% (полученных ранее) + $20\% = 54\%$ годовых уже даже используя лишь 75% от нашего депозита.

Мы конечно ради Вас, рассчитаем закуп на «снижении по сеточке» – ДО САМОГО КОНЦА)))

Хотя картина очевидна, при таком подходе, не ставя «стопы» – вы в любом случае выходите с хорошей прибылью. Никакого риска, только правильно выбрать «фишку». Весь риск тут состоит в том, что-либо биржу закроют, либо деньги отменят, либо сама акция – умрет. Но мы и выбрали на этот год Лукойл, чтобы наши деньги не умерли вместе с ним. Можете использовать Газпром или Сбербанк или Сургутнефтегаз. Кто чем

«хочет рискнуть».

На жирной зеленой линии мы расходуем последние 25% и берем 30% процентов из плеча.

Почему так мало?! – не забывайте портфель – без рисковый!

Остатки плеча доберем лишь при цене Лукойла 750 и будем звонить друзьям (всегда должен быть в наличии «звонок другу», откуда можно черпнуть сумму размере 100% от первоначального депозита, чтобы покрыть плечо а на остатки на дне набрать акций).

При желании, пропорции первоначальных закупок можно пропорционально увеличивать, вы конечно заработаете больше, но и портфель из разряда «безрискового», начнет становится все более и более рискованным...

При этом нужно учитывать, что чем ниже мы опускаемся, тем «Согласно теории Биржевого парадокса», отскок сильнее и выше, что дает возможность заработать гораздо больше, но вернемся к расчетам.

Последняя зеленая линия 900, тут мы берем последние 25%. Т.е. используем 100% своего депозита, а также «влезим» на 30% в плечо.

Купили на 25 %, т.е. купили на 250 тысяч по 900, продали уже по 1400 (в среднем).

Получили 138888 руб. прибыли. От суммы покупки это – 55,55 %, а от депозита 13,88%. Исходя из нашего графика, такая ситуация произойдет два раза /мы всегда берем минимум, в реальности повторится гораздо большее количество раз/. Т.е. мы получаем около 27,5 % + 54% (ранее) = 81,5% годовых уже даже используя 100 % от нашего депозита, при минимуме риска.

Последняя зеленая линия 900, тут мы берем и «влезим» на 30% в плечо.

Купили на 30 %, т.е. купили на 300 тысяч по 900, продали уже по 1250 (в среднем).

Получили 116666 руб. прибыли. От суммы покупки это – 38,88 %, а от депозита 11,66%. Исходя из нашего графика, такая ситуация произойдет два раза /мы всегда берем минимум, в

реальности повторится гораздо большее количество раз/. Т.е. мы получаем около $23,3\% + 81,5\%$ (ранее) = $104,8\%$ годовых уже даже используя 130% от нашего депозита, при минимуме риска.

Наши расчеты хороши тем, что мы все уменьшаем, поэтому полученную сумму смело можно умножить на 2.

Мы получаем $208,6\%$ годовых, если все упавшее за год вернется к своим уровням. И будьте уверены, если все упадет, то вернется – значительно быстрее, чем за год.

А теперь на десерт «звонок» другу. Казалось все упало, нужно плакать, но мы согласно нашей «Теории Биржевого парадокса – радуемся сложившейся ситуации». Мы просто звоним другу или папе с мамой и скажем при цене ЛУКОЙЛа 750 – получаем долгожданный дополнительный миллион. Т.е. еще один депозит. Мы даже плечи не берем уже/портфель то совсем у нас без риска/, просто покупаем на все деньги еще.

Страховочная покупка при 750, тут мы берем и «влезем» еще на 100% в Долг.

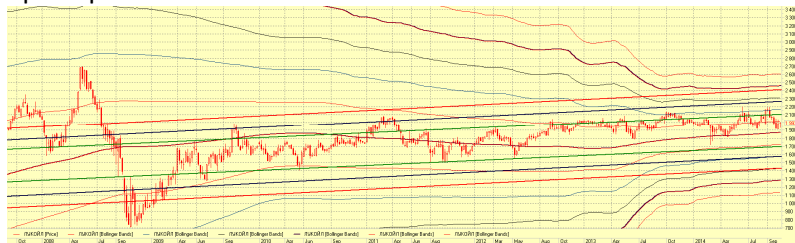
Купили на 1000 000, т.е. купили на новый депозит по 750, продали также по 1250 (в среднем). Немного получается «Дьявольская магия чисел».

Получили 666.666,7 руб. прибыли. От суммы покупки это – $66,66667\%$, а от второго депозита $66,66\%$. Исходя из нашего графика, такая ситуация произойдет 1 или 2 раза /мы всегда берем минимум, в реальности повторится гораздо большее количество раз/. Т.е. мы получаем около $133,3\% + 81,5\%$ (ранее) = $214,8\%$ годовых уже даже используя 130% от нашего депозита и один звонок другу, при минимуме риска.

Умножим как всегда на 2 и получим $429,6\%$ годовых, что мы и хотим продемонстрировать вам ОН-ЛАЙН в портфеле минимального риска...

Мы конечно понимаем, что это расчет, если свершились все условия и ходы, но уверяем вас, в реальной торговле ходов будет больше, а не меньше.

Заканчиваем пример, рассчитанный на глобальном снижении...и что мы видим? Мы планировали заработать даже на серьезном обвале, но акция следующие 5 лет была в жестких рамках 1500-2000 с максимальными выносами в район 2200, как на рисунке на странице 74., который мы показывали для примера.



Соответственно, наши три средних уровня от 1600 до 1900 работали практически все следующих после 2009 года 5-ти лет. Акция уверенно стояла в рамках заданного в нашей стратегии и учитываемый в наших прогнозах коридоре, а мы, регулярно перетряхивая портфель своими пакетами акций, всего лишь на 3-5 уровнях заработали бы достаточно денег и абсолютно без риска, не поставив ни одного стоп приказа.

Так к каким выводам мы пришли?

В системной и позиционной торговле, нам нужна волатильная акция, но зажатая в жесткие рамки ведущей рукой, которая сделает как можно больше движений от границы коридора к границе коридора, на всех известных ей уровнях, и чем больше движений внутри каждого интервала она сделает, тем нам лучше, ведь мы имеем свои пакеты – на каждом из часто повторяющихся уровней.

Соответственно, вывод по системной торговле, может быть только одним. Нам нужно, на каждом уровне, на часть депозита, третью или пятую его часть, но сделать как можно больше входов и выходов из рынка.

Таким образом, мы не можем разориться на брокерской нагрузке на депозит, которая исчисляется в годовом проценте на величину нашего депозита, и которая ограничивает нас в

том, чтобы совершать много сделок. Брокерская нагрузка на депозит никак не может повлиять на нас, если мы согласно системе, перетряхиваем пакеты акций без риска, без «стоп-приказа» и лишь на пятую или десятую часть депозита. И мы делаем это много раз, чем больше, тем лучше.

В указанном случае, чем больше мы совершим сделок на каждом уровне, тем средняя цена нашего входа будет ниже, тем больше мы получим прибыли по итогам нашей торговой деятельности.

Глава 18

Позиционность в торговле и причины возникновения

Рассмотрим пример позиционной торговли на самом катастрофическом падении на российском рынке акций, на графике компании Мечел.

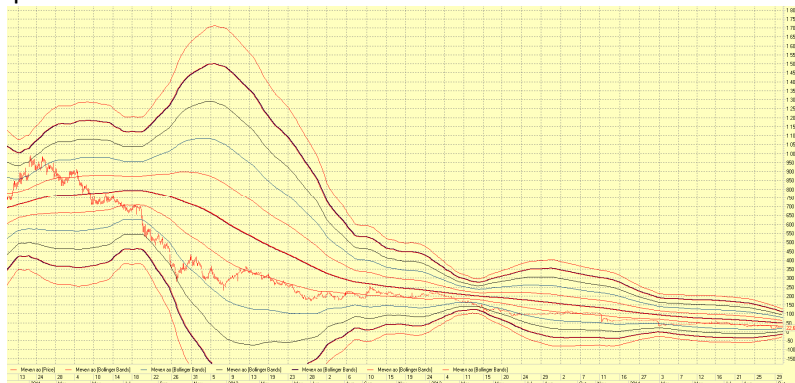


График движения в акциях Мечела, представляет собой страшное зрелище, так как акция за 3 года упала с 1000 рублей, практически до 10 рублей за акцию. Т.е. падение в 100 раз.

Этот катастрофический пример падения акций Мечела, даст нам возможность разобраться, что же такое позиционность и почему нам необходимо быть не только системный трейдером, который торгует малой частью депозита, но на всех уровнях.

Указанный график даст нам дополнительно понятие о том, что происходит с нашим счетом, при формировании портфеля, используя именно позиционный взгляд на рынок акций.

Итак, начало, цена 1000 рублей, и мы купили 1000 лотов на 1.000.000 рублей.

У нас в портфеле 1000 лотов по 1000 рублей.

Для простоты вычислений, мы возьмем широкий шаг, чтобы мы поняли само значение термина позиционность.

Пусть акция упала до цены 500 и вы поняли, что в сильной просадке.

Позиционный трейдер купит еще на 2.000.000 рублей по цене 500 и это будет еще 4000 лотов. Итого 5000 лотов за общую сумму 3.000.000 рублей.

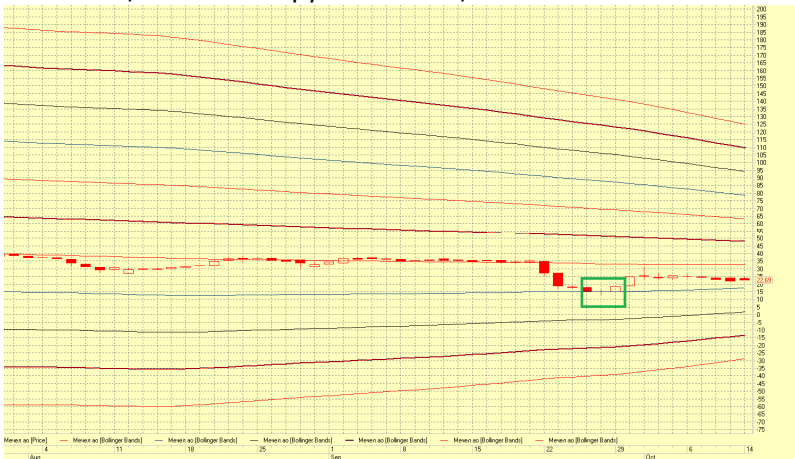
Соответственно, средняя цена станет $3.000.000 \text{ руб.} / 5000 = 600$ рублей.

Т.е. мы второй раз купили, но уже отбили 400 рублей от падения акций Мечела.

Ждем дальше и цена упала с 500 рублей до 100 рублей... мы, казалось бы, в жесткой просадке, но мы покупаем еще на 3.000.000 акций по 100 рублей... итогу у нас 35.000 акций... считаем среднюю, что мы видим:

$6.000.000 / 35.000 = 171,5$ руб. Т.е. средняя цена, от первого входа изменилась в 20 раз, т.е. мы практически догнали все катастрофическое падение.

И вот цена стала 15 рублей за акцию.



И позиционный трейдер, который вкладывает в риски только крах всех бирж в мире и снятие вашего тикера с торгов, берет и покупает еще на 6.000.000 рублей.

И у него на счете 435.000 лотов акций Мечела. Это не та жалкая 1000 с которой он начал, чтобы заработать, это в 435 раз больше.

Продолжаем расчет средней цены:

$12.000.000 / 435.000 = 27,5$ руб.

И на отскоке до 30 рублей, указанный трейдер вернет все свои деньги обратно, пусть даже сократив позицию в 10 раз, оставит всего 40.000 акций и будет ждать роста в 60 рублей.

Но, когда цена станет 60, то он заработает $40.000 * 30$ рублей = 1.200.000 рублей.

Этот пример не учит нас торговать, тем более не учит нас торговать правильно, он взят лишь для того, чтобы объяснить вам термин – позиционная торговля.

Т.е. при каждом новом движении вниз, трейдер значительно снижает среднюю цену своего актива, наращивая объем позиции и любой позиционный трейдер в среднестатистическом инструменте, который подвержен сильным коррекциям и взлетам – заработает гораздо больше, чем, если бы он был просто системным трейдером.

Нужно лишь полностью, поддерживать направление своей позиции от самого первого входа в акцию, никогда не фиксировать убыток и наращивать позицию – абсолютно весь интервал падения, после вашего первого входа по системе.

Естественно, чем опытнее трейдер, тем меньше времени занимает падение цены акции, после его входа в позицию по торгуемой им акции. Чем грамотнее трейдер и его система, тем он лучше видит развороты в своем инструменте, тем точнее он выбирает интервалы движения цены в торгуемой им акции, тем правильнее он распределяет средства для своих пакетов. Все вышеперечисленное приводит к тому, что он чаще фиксирует прибыльные сделки, чем его коллеги по цеху.

Поэтому, наша цель – трейдер «позиционный – системщик», который всегда выводит свои позиции в зону хорошей прибыли, а как мы убедились на примере, это можно сделать даже на акции, которая упала за три года в 100 раз, нужно лишь правильно распределять свои денежные средства.

Заключение

Математический расчет прибыли.

Брокерская нагрузка на депозит при 2 сделках в день.

Рассчитываем при комиссии брокера 0,01% и биржи 0,01%.

$(2 * 0,02) * 2$ (вход и выход, это одна сделка) = 0,08% в день.

25 торговых дней * 0,08 = 2% в мес.

Всего у вас... 50 сделок в мес.

24% в год брокерская нагрузка на депозит.

Если прибыль 102 руб. (за акцию) — 100 (руб. за акцию) = 2 р. Это 2% за одну сделку.

60 таких сделок ... Это 120% годовых. Минус нагрузка, это почти 100% годовых прибыли.

Но, нагрузка то, рассчитана, аж на 600 сделок в год.

Потому, берем 120 сделок в год.

По 1% прибыли. Как начальную базу расчета... и все равно в запасе аж 480 сделок...которые нужно совершить, чтобы попасть в норму сделок, на которые совершен расчет. Это в 4 раза больше, чем у нас есть.

Поэтому, чтобы получить 600 сделок, которые дадут 120% прибыли, нам нужно

600 сделок и каждая дает прибыль 0,2%.

Или 300 сделок по 0,4%... тогда нагрузка сократиться в два раза до 12% и мы получим...свои 108% годовых.

(Расчеты делаем без сложных процентов увеличения прибыли. Все расчеты опираются исключительно на первоначальную сумму депозита).

...А если Ваша комиссия 0,03...как это обычно есть, то тут все нужно пересчитать заново)))

Т.е. с биржевой у вас 0,04... огда, это 0,16 в день, это 4% в мес...это 48% в год...

Тогда вам нужно 300 сделок, на весь депозит (нагрузка сократится до 24%, так как расчет на 600 сделок в год)...но получите уже не 108% прибыли, а 96% прибыли.

Или те же 900 сделок в год, все прибыльные на 1/3 депозита... чтобы получить 96% прибыли...

Ну, так... легко... делаем 900 сделок... одинаковых... прибыльных... каждая дает по 0,4% прибыли... все подряд... и получаем свои 96% прибыли...

Как же нам использовать знание, что 300 сделок по 0,4%... тогда нагрузка сократится в два раза до 12% и мы получим...свои 108% годовых?

Очень просто.

Раз у нас есть разворотные точки по системе Шаблона, есть Система торговли, нам нужно добавить лишь выгодные расчеты выбора объема позиции, и он звучит именно так:

1. Нам нужно совершить в год, около 100 сделок с прибылью 1,2%.

2. $100 * 0,02\%$ (брокер + биржа, при комиссии 0,01%) и умножить на вход/выход, как условие одной сделки = всего 4% брокерская нагрузка на депозит.

3. Если минимизировать риски и входить всего 1/3 депозита, то брать нужно не 1,2% прибыли, а 3,6% прибыли, чтобы получить нужный результат, при этом брокерская нагрузка снизится до 1,33% процента, т.е. практически станет невидимой.

ВЫВОД:

1. Система Шаблона.
2. Системная Торговля.
3. Позиционная Торговля.
4. Уменьшение Рисков в три раза.
5. Комиссия биржи не больше 0,01%
6. Не более 100 сделок в год, с целью по прибыли 3,6 процента. Т.е. сделки по Сильным сигналам через день.

Только так, есть шанс выжить и если все сделки будут давать около 3-4% прибыли, то вы сможете заработать на бирже около 100% годовых.

ВПЕРЕД!