

Накопление сигналов

В сигнальных системах, горячо любимых трейдерами и аналитиками всех времен и народов, применяются тысячи индикаторов по всему миру. И это понятно, я сам составил их больше ста. Процесс творения новых индикаторов напоминает конструирование новых колес для велосипедов. Процесс творческий из-за стремления к совершенству и тяжелый, так как область решений ограничена. Процесс счастливый, если колесо годится к применению и хоть как-то приближается к идее качения с наименьшим сопротивлением.

Возможно, вы принадлежите к числу счастливиц, которые не заморачиваются и пользуются теми индикаторами, которые десятками встроены в торговые платформы или программы технического анализа. И у вас возникает вопрос: - «Зачем изобретать свои? Ведь можно приспособиться и торговать, пользуясь любым популярным индюком!» - И будете правы - соглашусь, потому что тоже так считаю. Но ценю свои изделия прежде других, хотя перепробовал к применению почти все встроенные в мою платформу приёмы обработки ценовых данных. Мои - лучше отражают личные пристрастия и представления о рынке.

Однако, что чужие, что собственного изготовления, индикаторы во-первых мультиколлинеарны [1], так как основаны на одних и тех же пяти показателях элементов ценового графика, а во-вторых, лучше всего подходят для выхода из позиции, так как подавляющее большинство из них представляют собой отслеживание скорости изменения данных, то есть тренда. Подавляющее число же, если не все, в боковом движении – врут.

Боковое движение, или «пила» – враг трейдера. Для некоторых – друг, но их - меньшинство по имени маркет-мейкеры, крупные игроки. По определению, они вынуждены стоять против рынка. Они останавливают увлекшихся импульсников и, если это удалось, включают роботов и проторговывают трендовый импульс обратно настолько глубоко, насколько им позволяют другие участники. В этом случае возможны три варианта развития событий: консолидация, возврат на прежние рубежи, продолжение импульса. Или их комбинация.

Давайте разберем частный случай, когда мы угадав направление, вовремя вошли вошли в рынок и перед нами стоит задача **наиболее удачно зафиксировать прибыль**. Я, прямо скажу, бывал в такой ситуации. Происходит внутренняя борьба между двумя проявлениями жадности: желанием цапнуть гарантированную прибыль и желанием имеющуюся прибыль максимизировать. Приверженцы первой идеи фиксируются, в основном, на конвертах от длинной средней (Александр Элдер) либо на конвертах ATR, т.е. с использованием каналов Кельтнера (Керри Ловворн). Приверженцы второй используют выход в целевой зоне (Ван Тарп) и разнообразные скользящие стопы (трейлинг), например такие как люстростопы (chandelier stop) или параболики (parabolic SAR).

Важнейший аспект выхода из позиции – это размерность. Один из моих бывших коллег, назовем его Егор, закрывал всю позицию либо по стопу, либо фиксировал прибыль после достижения целевой цены. Упрямый, как все трейдеры, он не желал разбивать сделки на более мелкие фракции, открывался редко, частенько нес убытки.

Наоборот, я принадлежу к той категории трейдеров, которые не могут заранее точно определить ту заветную зону, в которую стремится цена. Поэтому для выхода использую несколько полюбившихся индикаторов и **накопление их сигналов**. В отношении размерности, придерживаюсь правила

множественного частичного выхода

, в соответствии с последовательностью срабатывания. Ведь нам нужно достоверно уловить момент, когда рынок приседает отдохнуть, а одномоментно это удастся сделать редко. Для этого можно настроить индикаторную систему на одном таймфрейме вместо использования правила тройного экрана д-ра Элдера.

Рассмотрим скальперскую ситуацию, когда мы следим за внутрисуточным графиком, где много шума и ложных сигналов. Я использую стратегический индикатор stop для оценки стратегии, который отвечает на вопрос «куда?»; тактический индикатор [Sum](#) или трендово-тактический индикатор

[Piano](#)

для ответа на вопрос «когда?»; резвый

[Mcs](#)

для уменьшения позиции в перерывах ценового размашистого движения и перевхода после; и наконец, осциллятор

[Sir](#)

для скальпирования. Короче говоря, в моей трендовой тактике предусмотрено последовательное уменьшение позиции по мере возникновения разворотных сигналов. Когда накопятся все – выхожу в ноль. При этом, как правило, мы наблюдаем консолидацию, то есть пилу.

Подобный подход обеспечивает нам нахождение в позиции столь долго, пока длится тренд, пусть даже иногда позиция остается небольшой. Вопрос о том, сколько именно закрывать по мере срабатывания каждого из сигналов оставляю открытым, так как это предмет личных предпочтений и целей торговли. Представляется логичным оценивать силу импульса ценового движения. Чем сильнее энтузиазм трейдеров, тем б

ольший вес следует придавать стратегии.

Вопросы открытия позиции при входе в рынок, случаи продолжения трендового импульса а также контртрендовая тактика в случае разворота будут являться предметом будущих статей.

23.11.13 *bvt*

[1] мультиколлинеарность – линейная зависимость переменных, корреляция. Так, коллинеарны параллельные векторы, коллинеарны код ДНК и соответствующая молекула белка. Переменные мультиколлинеарны, если коэффициент корреляции > 0.7