

"ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЙ ПЛАН СВИНГОВОЙ ТОРГОВЛИ ПО СИСТЕМЕ ГАННА." (3)

В нашем последнем выпуске, я уже говорил, что нечто тревожное происходит на фондовом рынке. В последнее время, в моем сознании возник образ человека, размахивающего красным флагом, как символом тревоги. Ну, что ж, этот парень, определенно, размахивал флагом не зря.

Нынешние времена отмечены высокой волатильностью, и поэтому, именно сейчас, нам, специалистам технического анализа, платят повышенные гонорары, за нашу работу в тиши домашних кабинетов, и за наше внимание к деталям. К слову о деталях, многие из вас заметили типографские ошибки на странице 5 предыдущего выпуска. В подписях к графикам №1 и 2 должно было быть написано «дневные бары S&P 500», а не «9-минутные бары». Как бы то ни было, но техника анализа, обсуждавшаяся там, работает результативно. Зайдите на Веб-сайт FT, и вы увидите там хорошую часовую торговлю по индексу S&P, с использованием Динамических Каналов Фибоначчи, и прочих инструментов.

Еще пара новостей по нашему «хозяйству». Мы получили несколько ценных соображений от наших респондентов, и результатом этого стало одно из изменений, которые мы сделали в журнале, а именно - вставили номер страницы, вместе с номером выпуска, в нижней части каждой страницы. Наконец-то, 32-битная версия программы Fibonacci Trader уже почти готова. Мы ждем доработки нового руководства пользователя, ключевой части этого обновления. Окончательная дата выхода в свет, и детали этого события, будут помещены на нашем Веб-сайте, и мы, к тому же, оповестим вас об этом по e-mail. В нашем первом выпуске, я говорил, что, время от времени, я буду доводить до вашего сведения о существовании какого-нибудь ценного программного продукта, или сервиса, который, по моему мнению, был бы для вас полезным. Так вот: новая книга Майкла Дугласа «Торгуя в Зоне» попадает в эту категорию. Я прочитал ее, и могу сказать только одну вещь: купите эту книгу! Этот автор обладает замечательным подходом к той ментальной игре, которая называется трейдингом. Как я уже отмечал в моем интервью в New Market Wizards, трейдинг является на 75% продуктом ментальности. И, поэтому, книга «Торгуя в Зоне» - лучше, чем первая книга Дугласа, «Дисциплинированный трейдер». Читайте эту книгу, используйте ее в своей деятельности. Она не дешева, при цене \$150.00, однако стоит того. Фирма PAS, Inc. имеет ее на своих складах. Звоните 512 443-5751. Теперь, что касается темы этого выпуска. Как следует из заглавия, текущий выпуск сфокусирован на Профессиональном Плате по свинговой торговле фьючерсами казначейских облигаций. Правила этого плана, первоначально, появились в моей книге «Раскрытое наследие У.Д.Ганна». Тем из вас, кто купил эту книгу (и прочитал ее), не надо расстраиваться. Как читатели FT Journal, вы будете посвящены в нюансы и соображения, которые не обсуждались в моей книге, да и, плюс к тому, мы покажем здесь текущее исполнение этой стратегии, для нынешнего года. Почему мы отдельно решили разобрать этот план? Потому, что он, до сих пор, был довольно результативным, с тем, что, в течение 8 с половиной лет ретроспективного тестирования, не было ни одного убыточного года. Этот план работает хорошо и в условиях волатильных рынков текущего года. Взгляните на эту таблицу ниже, и на таблицу на странице 8. Я включил в этот выпуск таблицы, показывающие результаты торговой деятельности, вплоть до настоящего момента, а также, график, показывающий течение торговли за два последних месяца, с правилами для этой торговли. Конечно же, я не могу гарантировать, что этот план будет продолжать работать с таким же результатом, и в будущем. План несложный, считая, что мы используем данные реального времени. Результаты такой торговли довольно приемлемые, потому что этот план содержит важные элементы для механически применяемого плана трейдинга, а именно: А) Фиксированные правила В) Ретроспективное тестирование на протяжении многих лет С) План динамичен по природе D) В плане предусмотрены возможности манименеджмента Е) Присутствуют ясные определения тренда и изменений тренда F) Присутствуют ясные определения сопротивления и поддержки G) Точки вхождения в сделку и выхода из сделки H) Правила и цели защиты прибыли

Именно благодаря такому подходу, этот план обеспечил выручку в более 80% от капитала, с максимальным снижением на 7%, при сумме \$30,000 на счету, в этом году (1 января – 7 октября), без учета комиссионных. Вы можете вычесть такую сумму комиссионных, которая вам нравится. Почему казначейские облигации? Это очень ликвидный контракт, и, независимо от количества торгующих пользователей программы FT, очень маловероятным представляется нарушить ритм этого плана. Можете ли вы адаптировать лучшие черты этого плана для применения в торговле на вашем «любимом» рынке, или для вашего стиля торговли? Я уверен, что вы знаете ответ на этот вопрос. Однако вам следует проверить это очень внимательно. Пересильте себя, сделайте эту работу самостоятельно. Следует обратить внимание на два важных момента: 1) Внимательно отнеситесь к правилу 10/20 минут. 2) Об изменении направления Активатора HiLo можно говорить только тогда, когда противоположная сторона (цвет) «выскочила» на экране монитора, т.е. когда этот индикатор перевернулся другой стороной.

1998 NEW GANN SWING CHARTIST™ PROFESSIONAL SWING PLAN DAILY T-BONDS			
Beginning Equity	\$30,000.00	Ending Equity	\$56,437.50
Total Net Profit	\$26,437.50	Gross Loss	(\$10,781.25)
Gross Profit	\$37,218.75	Percentage Profitable	63%
Total No. Trades	30	No. Losing Trades	11
No. Winning Trades	19	Largest. Losing trades	(\$2,343.75)
Largest Winning Trade	\$8,656.25	Average Losing trade	(\$980.11)
Average Winning Trade	\$1,958.88	Average Trade	\$881.25
Ratio Average Win/Loss	2.00	Max. Consecutive Losses	3
Max. Consecutive Drawdown (%)	6.89%	Largest Consecutive Drawdown	(\$2,343.75)
		Notes:	1) Initial A/C Size = \$30,000
Return on account	88%		2) Pyramids only 1/3 of original position
Profit/Drawdown ratio	11.28		3) commissions not included

На следующих пяти страницах, для вашего изучения, представляются эти правила, с примерами, а также, некоторые ключевые моменты - на странице 3. Если какие-нибудь из этих правил изложены неясно, то, пожалуйста, напишите мне. Не игнорируйте разработку Дневного Списка Проверки. Это очень полезный инструмент для эффективной торговли. Некоторые тонкие моменты будут обсуждаться в следующем выпуске FT Journal, однако все необходимое для понимания темы уже присутствует в текущем номере. В следующий раз, мы будем обсуждать Свинговую Торговлю по Множественным Временным Интервалам.

Желаю Вам превосходной торговли,

Роберт Крауз, МН, ВСНЕ

Профессиональный План Свинговой Торговли по Системе Ганна (Реальное Время) для фьючерсов по казначейским облигациям

Профессиональный План очень отличается от Базового Плана. В случае Профессионального Плана, акцент делается на увязке торговли с дневным ритмом рынков. Рынок может быть сравним с рекой, и трейдинг, в таком случае, заключается в следовании по направлению, и за скоростью течения этой реки. Рынки, так же как и течение реки, будут всегда двигаться по линии наименьшего сопротивления. Задачей этого плана заключается делать то же самое. Комиссионные недороги, по сравнению с убытками, которые сильно увеличиваются, в случае занятия неверной позиции на рынке. Этот план требует дисциплины. Аккуратное и последовательное выполнение требуют бдительности и полной концентрации внимания. Вам не следует становиться рабом своей позиции - меняйте направление, если ситуация на рынке того требует. Вот почему этот план называется профессиональным. Приведу список основных различий этого плана от Базового плана: 1) По этому плану, вы торгуете как по тренду, так и против тренда. 2) Используются Правила Защиты прибылей, таким образом, трудно доставшиеся прибыли не отдаются легко назад. 3) Мы фиксируем прибыли при уровнях, которые я называю Целевыми Точками, по части нашей общей позиции. Каждая новая сделка состоит из 3 контрактов. Заметьте: Эти Целевые Точки устанавливаются рынком, и не являются некой произвольной суммой денег, о которой я, или вы, мечтаем. 4) Вы можете выстраивать пирамиду (добавлять) по вашей позиции, при соблюдении специальных условий. 5) Повторное вхождение в сделку, если вы вышли (соблюдая правила) слишком рано, является неотъемлемой частью плана. 6) Активатор HiLo недельных баров, наложенный на дневные бары, становится функциональным правилом для этого плана. Это знакомит вас с концепцией Множественных Временных Фреймов, и с тем, насколько полезными они могут быть для механических торговых планов.

ЕЖЕДНЕВНЫЙ СПИСОК ПРОВЕРКИ.

Ежедневный список проверки является ценным инструментом для управления вашей торговлей в течение часов работы рынка. Вам следует разработать свой собственный такой план. Изучите правила, и пересмотрите свои сделки, прежде, чем приступите к созданию своего ежедневного списка проверки. Да, это дополнительная работа, однако время, потраченное на совершенствование этого плана, приведет к большей уверенности в совершении сделок. К тому же, разработка вашего собственного списка проверки сделает торговлю более естественным процессом, потому что вы будете следовать работе своих рук и головы. Прежде чем вы начнете разрабатывать свой список проверки, пересмотрите ход торгов в обратном порядке (ретроспективно). Это поможет вам справляться с давлением реальной торговли, когда ее ход идет против вас. Вы будете знать, что, если у вас и были четыре, или пять, убыточные сделки подряд, этот план, все же, смог компенсировать эти потери, и вы выжили. Когда такая ситуация возникает в реальной торговле (а это, действительно, будет), то вы не будете потрясены. Второе, и наиболее важное из этих двух замечаний: посредством повторения, подсознание медленно начнет понимать значимость этого плана. Вручную, проведите многолетний ретроспективный анализ, применяя эти правила к каждому бару. Тогда, вы будете знать этот план изнутри, и будете знать уровень враждебности, которая, просто, является частью взлетов и падений торговли. Итак, что же должно входить в этот список проверки? Какие правила должны быть наиболее важными для вас? Это главный вопрос. Пройдитесь еще раз повсем правилам, и расставьте их в вашем собственном порядке. Тогда, вы сможете персонализировать этот план. На следующих страницах, приводятся правила Профессионального Плана торговли по свинговой системе Ганна.

ПРАВИЛА ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ПЛАНА (ДЛЯ СЛУЧАЯ КАЗНАЧЕЙСКИХ ОБЛИГАЦИЙ)

Правила 10/20 минут. Каждым утром, ждите до того момента, когда первый 10-минутный бар оформится, а затем, используйте стоп, на 2 тика выше или ниже, в качестве сигнала. Если поступает какое-либо сообщение о состоянии экономики, то подождите, пока первый 20-минутный бар не оформится, и, затем, используйте проникаемость на 2 тика, прежде чем предпримете действия.

Торговля по тренду. Определитель момента для совершения покупки. 1. Свинговый график Ганна должен показывать сплошную (зеленую) линию. Правило вхождения в сделку (для покупки). 1. Входите в длинную позицию, при закрытии на два тика выше Активатора HiLo, в случае казначейских облигаций. 2. Входите в длинную позицию, если цены уходят выше предыдущего пика. Определитель момента для совершения продажи. 1. Свинговый график Ганна должен показывать пунктирную (красную) линию. Правило вхождения в сделку (для продажи). 1. Входите в короткую позицию, при закрытии на два тика ниже Активатора HiLo, в случае казначейских облигаций. 2. Входите в

короткую позицию, если цены уходят ниже предыдущей долины. Торговля против тренда. Определитель момента для совершения покупки. 1. Свинговый график Ганна должен представлять из себя пунктирную линию. 2. Закройте выше Активатора HiLo. Правило вхождения в сделку (для покупки). 1. Входите в длинную позицию, когда цены проходят выше максимума того бара, который закрылся выше Активатора HiLo (это не обязательно должен быть бар следующего дня). Определитель момента для совершения продажи. 1. Свинговый график Ганна должен представлять из себя сплошную линию. 2. Закройте ниже Активатора HiLo. Правило вхождения в сделку (для продажи). 1. Входите в короткую позицию, когда цены проходят ниже минимума того бара, который закрылся ниже Активатора HiLo (это не обязательно должен быть бар следующего дня).

Правило особого вхождения в сделку (длинная или короткая позиция).

Определитель момента для совершения покупки. Дневной бар закрылся на 3 тика ниже Активатора HiLo для периода Next.

Правило вхождения в сделку (для покупки). Входите в длинную позицию на следующем баре, который реверсирует проникновение на три тика назад, выше Активатора HiLo для периода Next (недельного). Не ждите закрытия рынка.

Определитель момента для совершения продажи. Дневной бар закрылся на 3 тика выше Активатора HiLo для периода Next.

Правило вхождения в сделку (для продажи). Входите в короткую позицию, в момент проникновения на три тика ниже Активатора HiLo для периода Next. Не ждите закрытия рынка. Заметьте: Активатор HiLo для периода Next (недельного) вычерчен в линейной формации (ступенчатая формация не нужна).

Специальное правило Стоп и Реверсирования. 1. В длинной позиции, совершите стоп-реверсирование после прохождения на 2 тика ниже ближайшей долины, если только обычное правило вхождения в сделку не задействовано первым. 2. В короткой позиции, совершите стоп-реверсирование после прохождения на 2 тика выше ближайшего пика, если только обычное правило вхождения в сделку не задействовано первым.

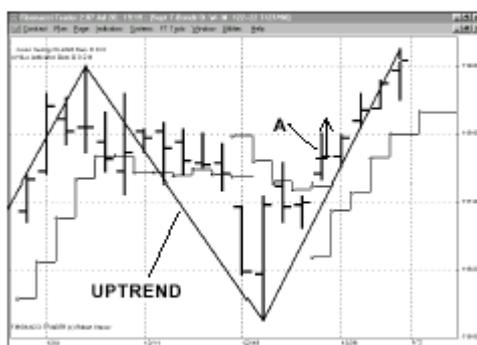
Правило повторного вхождения в сделку. Если рынок проходит вашу точку Защиты Прибыли (смотрите Правило Защиты Прибыли), но нет сигнала реверсирования, то вновь войдите в сделку, в течение дня, когда: 1) самый недавний изолированный максимум или минимум пройден на 2 тика, или 2) самый недавний предыдущий пик или долина пройден на 2 тика, или 3) максимум или минимум того бара, который прорвал Активатор HiLo, пройден на 2 тика. Ожидать, или нет, закрытия за пределами предыдущего пика (или долины) – это личный выбор каждого. Результаты данного торгового плана базируются на допущении, что вы не ожидаете до закрытия.

Цели (используйте ту, которая достигнута первой). 1. Фиксируйте прибыль по 1/3 ваших позиций, на закрытии первого бара, который приводит к изменению склона свинга. Это правило применяется даже тогда, когда сделка оказалась убыточной. Продолжайте консолидировать прибыли на каждом таком сигнале (это – на ваш выбор, я использую это правило только один раз). 2. Фиксируйте прибыли по 1/3 ваших контрактов, если цена доходит до Активатора HiLo периода Next (недельного). Используйте либо правило 1, либо правило 2.

Правила пирамиды. 1. Выстраивайте пирамиду (добавляйте) 1/3 вашей первоначальной позиции, при достижении точки изменения тренда (т.е., если длинная позиция, и свинговый график меняет свое представление на сплошную линию). 2. Выстраивайте пирамиду (добавляйте) 1/3 вашей первоначальной позиции, когда пройден предыдущий пик (или долина), в течение одного дня.

Правила Защиты Прибыли (используйте то, которое задействовано первым). 1. Любой 38,2%-ный ретрэйсмент предыдущего свинга. 2. Любое проникновение на 2 тика за пределы дневного Активатора HiLo.

Правила вхождения в сделку



Правило покупки #1: Покупайте на баре А, коль Свинговый График Ганна показывает тренд вверх (сплошная линия). Сигнал о покупке возникает на баре А, когда цены закрываются выше Активатора HiLo.



Правило продажи #1: Продавайте на баре А, коль Свинговый График Ганна показывает тренд вниз (пунктирная линия). Сигнал о продаже возникает на баре А, когда цены закрываются ниже Активатора HiLo.



Правило покупки #2: Покупайте на баре А, когда цены превосходят предыдущий пик, коль Активатор HiLo находится ниже этих баров. Программа Fibonacci Trader меняет представление линии с пунктирной на сплошную, так как тренд меняется от тренда вниз на тренд вверх.



Правило продажи #2: Продавайте на баре А, когда цены падают ниже предыдущей долины, коль Активатор HiLo находится ниже этих баров. Программа Fibonacci Trader меняет представление линии со сплошной на пунктирную, так как тренд меняется от тренда вверх на тренд вниз.



Торговля против тренда (покупка): Линия Свингового Графика Ганна пунктирная. Вы можете покупать, когда цены вырастут на два тика выше максимума того бара, который закроется выше Линии Активатора HiLo. Действия предпринимаются в течение дня. Сигнал о покупке возникает на баре В. Вы можете войти в сделку после бара В, так как максимум бара А превзойден.



Торговля против тренда (продажа): Линия Свингового Графика Ганна сплошная. Вы можете продавать, когда цены упадут на два тика ниже минимума того бара, который закроется ниже Линии Активатора HiLo. Действия предпринимаются в течение дня. Сигнал о продаже возникает на баре В. Вы можете войти в сделку после бара В, так как минимум бара А пройден.

Правила Особого Вхождения в Сделку.

Этот набор правил вводит в наш торговый план использование Активатора HiLo для периода Next. Так как наш план является планом Дневной/Недельный/Месячный, то для расчетов в периоде Next используются недельные бары. Следовательно, недельные максимумы и минимумы являются базисом для Активатора HiLo для периода Next. Когда вы устанавливаете этот индикатор, перейдите к меню Draw Type, и выберите опцию Line. Мы не используем ступенчатую формацию для периода Next, как это делается для Активатора HiLo для периода Own. Здесь, Активатор HiLo для недельного периода используется в качестве уровня поддержки, или сопротивления, для правил торговли.



Правило особого вхождения в сделку (Покупка): Бар А торгуется ниже недельного Активатора HiLo, и закрывается ниже его на три тика. Бар В торгуется опять выше этого Активатора HiLo. Предполагается длинная позиция, если цена будет торговаться на 3 тика выше недельного Активатора HiLo.



Правило особого вхождения в сделку (Продажа): Бар А торгуется выше недельного Активатора HiLo, и закрывается выше его на три тика. Бар В торгуется опять ниже этого Активатора HiLo. Размещается короткая позиция, если цена будет торговаться на 3 тика ниже недельного Активатора HiLo.

Правила повторного вхождения в сделку.



Остановитесь, и реверсируйте (для Правила особого вхождения в сделку (Покупка)): Бар А торгуется опять на 3 тика выше недельного Активатора HiLo, указывая на необходимость длинной позиции. Однако Бар В торгуется опять ниже ближайшей долины, возобновив тренд вниз.



Правило повторного вхождения в сделку, при игре по тренду: Текущий тренд – вниз. Если цены проникают на 2 тика через бай-стоп Активатора HiLo, то, в этом случае, Правило Защиты Прибыли №2 остановит вас. Вновь войдите в сделку на баре В, когда рынок пройдет ниже уровня предыдущей долины на 2 тика.

Цели.



Правило цели №1: В данном случае, цель – это изменение склона (а не изменение свинга). Фиксируйте прибыль по 1/3 позиции.



Правило цели №2: В данном случае, цель – это Активатор HiLo для периода Next Time. Фиксируйте прибыль по 1/3 позиции. Используйте правило 1 или 2 (на ваш выбор) всякий раз, когда складываются для этого условия.

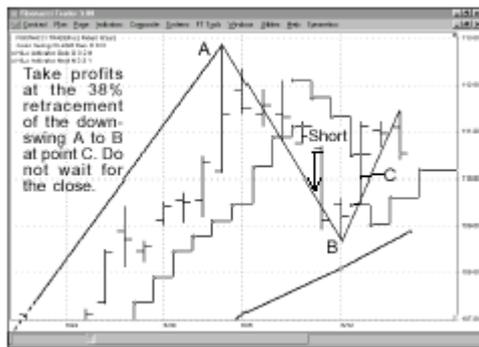
Правила пирамиды.



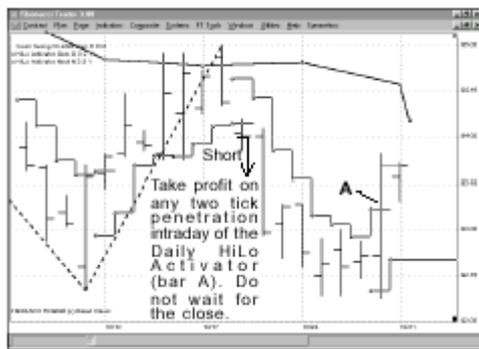
Точка пирамиды, после вхождения в длинную позицию: Если план уже длинный, то вы можете добавить 1/3, когда тренд меняется на вверх (сплошная линия).



Точка пирамиды, после вхождения в короткую позицию: Если план уже короткий, то вы можете добавить 1/3, когда тренд меняется на вниз (пунктирная линия).

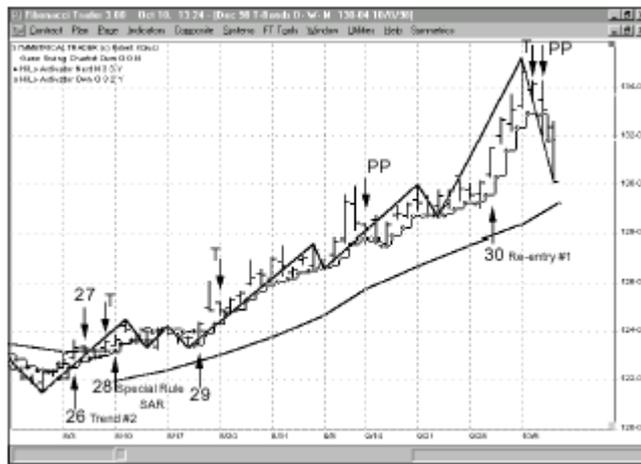


Фиксируйте прибыли, при ретрэйсменте 38% свинга вниз (от А до В), на точке С. Не ждите закрытия рынка.



Фиксируйте прибыли, при проникании на 2 тика через дневной Активатор HiLo, в течение одной сессии (бар А). Не ждите закрытия рынка.

Trade #	Date	L/S	Price	CTR	Rule #	Profit (Loss)	Accum.	Monthly Profit(Loss)	AC Equity
26	8/4/98	L	123-14	3	Trend 2				
27	8/5/98	S	123-12	6	Special Rule	(6)	840		\$56,250.00
T	8/6/98	L	123-27	1	T1	(15)	825		\$55,781.25
28	8/10/98	S	123-30	5	Special Rule SAR	(38)	789		\$54,656.25
PP	8/12/98	S	123-24	3	PP2	(18)	771		\$54,093.75
29	8/20/98	L	124-16	3	Trend 1				
T	8/24/98	S	125-02	1	T1	18	789		\$54,656.25
PP	9/14/98	S	127-31	2	PP2	186	975	129	\$60,468.75
30	9/30/98	L	130-11	3	Re-entry #1				
T	10/6/98	S	134-04	1	T1	121	1096		\$64,250.00
PP	10/7/98	S	132-25	2	PP2	156	1252	277	\$69,125.00



Эта таблица приводит данные по последним сделкам и правилам. Эти же самые сигналы, также, представлены и на этом графике. Этот план использует начальный актив \$30,000, и первоначальную позицию в 3 контракта, для каждой сделки. Соскальзывание и комиссионные не включены.