

# Система Свинг-трейдинга

## Swingtrade System

Брэндон Фридриксон  
Brandon Fredrickson

Меня зовут Брэндон Фридриксон. Я и Тони Хансен - советники по свинг-трейдингу в MTrader. Прошу заметить, что методы свинг-трейдинга, представленные здесь, направлены на получение прибыли за более длительный промежуток времени, и этим отличаются от методов momentum daytrading от Ken Wolff.

Свинг-трейдинг - это техника, направленная на получение прибыли из естественных 3 - 5 дневных циклов рынка. впервые описанных George Douglas Taylor в The Taylor Trading Technique. Я слегка усовершенствовал метод мистера Тейлора, но основные положения свинг-трейдинга совпадают с изложенными в его книге.

Мы уверены, что свинг-трейдинг (с длительностью позиции 1 - 5 дней) - прекрасная альтернатива для рядового инвестора. Многие успешные трейдеры мира торгуют в стиле свинг-трейдинга.. Моя цель - научить этому методу и Вас.

### SWINGTRADE SYSTEM

Когда я начинал торговать, мне представлялось все это в целом достаточно сложным занятием, в конце концов я состязался с умнейшими людьми мира и искушенными учреждениями. Так, для меня, чтобы войти в сделку, должно было быть равновесие сил, так, чтобы кое-что говорил стохастик, а кое-что Williams % R, в общем, я думаю, Вы представляете себе картину. Как ни странно, я терял много денег. Главная проблема с такими системами состоит в том, что их используют так много людей, что они не работают достаточно хорошо.

Я хотел быть трейдером примерно с 10-летнего возраста, так что неудачи не могли выбить меня из колеи. Забавная вещь, я имел очень простую систему, которой поделился со мной великодушный брокер из Миннеаполиса, а трейдер из Чикаго подтвердил. Я мог привести массу причин, почему ее не следует использовать. Они - брокеры, и то, что используют они, не сработает у меня. Вообще-то, это может быть правдой, но системы ECN'S и Super DOT Нью-Йоркской Фондовой биржи изменили это. Я имел доступ, который был почти столь же хорош как и у брокера. Следующее оправдание, почему я не должен был использовать это, система слишком проста. На самом деле, простые вещи работают очень хорошо.

**ТОРГОВЛЯ ПО ТРЕНДУ:** Один из главных постулатов, который успешные трейдеры сообщат Вам, если Вы сможете их разговорить, это не торговать против тренда, но было также и основным компонентом моей системы. Я не торгую против главного тренда. Если Вы торгуете по тренду, это придает основной импульс акции, товара, валюты или облигации в вашу пользу. Тенденции всегда сохраняются, пока фундаментальные экономические причины не изменят их. Трейдеры настолько привыкают покупать XYZ на откатах, что становится очень трудно изменить эту привычку.

**ИДЕНТИФИКАЦИЯ СИГНАЛОВ НА ПОКУПКУ:** Основной набор сигналов на покупку, который я ищу, очень просто определить. Я отбираю акции в восходящем тренде на дневном графике, предпочтительно также и на недельном. Затем среди них Я ищу акцию, которая последние 3 - 5 дней торговалась против тренда. Сигналы на покупку Swingtrade и действия:

Акция в восходящем тренде

Откат на дневных графиках последние 3 - 5 дней

Ставим сигнал выше максимума предыдущего дня

Когда акция поднимается на 1/8 - 1/4 выше максимума предыдущего дня, покупаем ее

Ставим стоп на 1/8 - 1/4 ниже минимума предыдущего дня, избегая целых чисел (десятки и пятерки).

Этот набор может использоваться и сам по себе, хотя я этого не советую. Я всегда ищу комбинации, чем больше подтверждений, тем меньше риск. Теперь я хочу осветить некоторые комбинации, которые Вам нужно искать.

**МАЛАЯ ПОДДЕРЖКА:** Всегда, когда цена акции опускается к области поддержки, риск покупки снижается. Это особенно истинно для акций в восходящем тренде. Малая поддержка определяется, как область пика цены на последнем подъеме. Объясняется это тем, что прошлое сопротивление станет новой поддержкой.

**ПОДДЕРЖКА СРЕДНЕЙ:** Простые скользящие средние - прекрасный индикатор тренда в большинстве случаев. Они также служат хорошими индикаторами областей поддержки и сопротивления. Основные скользящие средние, которые служат поддержкой в моем наборе для свингтрейда - 10, 20, и 40 (50). Чем сильнее акция, тем ниже значение средней и выше потенциал прибыли, так что акция, находящая поддержку на 10МА лучше, чем на 20, и так далее.

**ВНУТРЕННИЙ ДИАПАЗОН:** День внутреннего диапазона, это такой, когда размах от минимума до максимума полностью укладывается внутри диапазона цен за последние дни. Прорыв из внутреннего диапазона, особенно в направлении преобладающего тренда, предлагает прекрасные возможности для покупки. Причина этого в том, что день внутреннего диапазона представляет продавцов, становящихся менее уверенными в продолжении падения акции. Много раз, когда акция взлетает после такого бара, образуется день, в котором открытие является минимумом, а закрытие - максимумом.

**ТРИ РАЗНЫХ ЛИЦА РЫНКА:** Рынки существуют трех различных состояниях. Первое - Accumulation - Накопление - когда "умные деньги" медленно создают позиции, больше для разговоров. У меня нет миллионов долларов, чтобы тратить их на аналитиков, которые сообщают мне, что акция, наконец, достигла дна, и я должен начать покупать, так что я игнорирую это состояние. Второе лицо рынка - трендовое. Это средняя фаза рынка, "суть" движения. Это та область, на которой я стараюсь сосредоточиться, поскольку тренды очень просто идентифицировать и нелегко изменить. Заключительная фаза рынка - distribution - распределение. Это - когда каждый "знает", что акция или взлетит на луну, или пойдет к черту. Здесь "умные деньги" выходят, а глупые входят. Мы также пытаемся избегать действий в этой области рынка.

**ТРЕНДЫ:** Важно понимать, что всегда имеются три тренда, работающих на рынке. Долгосрочный тренд, который является вотчиной инвесторов, и может быть замечена на годовом, месячном и недельном графиках. Промежуточный тренд, на котором работают свинг-трейдеры, определяется на недельном, дневном и часовом графиках. Краткосрочный тренд - для трейдеров, мы видим на дневном и внутрисуточном графиках.

Многие скажут Вам, что единственный путь, которым Вы можете сделать большие деньги на рынке, состоит в том, чтобы идентифицировать изменение тренда, и торговать на этом. Меня

столько раз ставили за это в угол, что я давно отказался от этого. В беседах со многими настоящими трейдерами, которых я знаю, как очень успешных, они подчеркивали снова и снова, что нельзя бороться с трендом. Никогда! Так что первое, что нужно сделать - определить, каков тренд. Чтобы сделать это, мы нуждаемся в нескольких определениях. Мы должны идентифицировать восходящие акции. Мы должны идентифицировать нисходящие акции. Это - основа, от которой начинается движение. Удостоверьтесь, что Вы понимаете тренд раньше, чем предпринимать какие-либо действия.

**ВОСХОДЯЩИЙ ТРЕНД:** Аптренд - общее ценовое движение рынка, которое характеризуется серией подъемов, каждый из которых преодолевает максимум предыдущего подъема. Эти подъемы перемежаются откатами, минимум каждого из которых выше минимума предыдущего. Другими словами, восходящий тренд - череда более высоких максимумов и более высоких минимумов.

**НИСХОДЯЩИЙ ТРЕНД:** Даунтренд - общее ценовое движение рынка, которое характеризуется серией понижений, каждое из которых преодолевает минимум предыдущего снижения. Эти понижения перемежаются подъемами, максимум каждого из которых ниже максимума предыдущего. Другими словами, нисходящий тренд - череда более низких минимумов и более низких максимумов. Я использовал определения из Теории Доу, описанной Charles Dow и Robert Rhea.

Далее >>>

## Правила Свинг-Трейдера от MTRADER

Хотя в торговле нет никакого святого Грааля, есть несколько правил, которые, если их соблюдать, сохраняют Вас в игре, пока Вы захотите там оставаться. Мы не предлагаем здесь чего-нибудь нового, или каких-то инвестиционных секретов, самый большой секрет в инвестиционном мире - это то, что нет никаких секретов. Есть лишь некоторые полезные правила:

Покупка (или короткая продажа)

1) Маркет ордер: Правило по маркет ордеру простое - его не нужно использовать. Маркет ордер просто говорит вашему брокеру исполнить ваш приказ так и тогда, как он сможет. Я уверен, что мы все слышали эти самые ужасные истории, так что нет необходимости их повторять. Всегда пользуйтесь лимит ордером, если же Вы хотите чего-то большего, поставьте ордер на несколько уровней дальше от текущей цены. На NASDAQ Вы, вероятно, получите эту цену, в то время как специалист NYSE обработает ваш приказ подобно маркет ордеру, но Вы добавите себе защиту.

2) Бай стоп ордер: Этот тип ордера будет очень важен для тех из Вас, кто не весь день проводит у компьютера. Он просто инструктирует вашего брокера купить акцию, как только она будет торговаться выше некоторой цены. Как только эта цель цены достигнута, ваш ордер будет выполнен на самых выгодных условиях из возможных. Так, если мы хотим купить XYZ выше 35, тогда Вам нужно разместить ваш бай стоп ордер на 35 1/8. Важное примечание по этому типу ордера - он не может быть размещен, пока рынок не открылся.

3) Никогда не торопите события: Не предпринимайте никаких действий на рынке, пока не достигнуты ваши заранее определенные цели. Если мы хотим купить что-то выше 30, это значит, по крайней мере, 30 1/16, а скорее, 30 1/18. Это не означает "похоже, 30 пробивается". Мне трудно представить что-то столь же дорогостоящее, как такие предположения. Покупка и короткие продажи происходят по определенным ценам, потому что имеются веские причины для того, чтобы цены были именно там.

4) Никогда не покупайте акцию на  $3/8$  выше (или ниже при короткой продаже) от идеальной цены входа. Не гонитесь за ушедшим поездом. Гораздо лучше один раз постоять в стороне, чем поддаться горячке момента и закончить взятием больших убытков, чем было необходимо.

5) Никогда не покупайте акцию, упавшую (или выросшую при короткой продаже) на  $1/2$  и ниже идеальной входной точки, исключая правило разрыва.

## РАЗРЫВЫ

Разрывы могут представлять реальную опасность для вашего счета. Если мы приказали купить XYZ выше \$ 30, а она делает разрыв на \$  $30 \frac{1}{2}$  на первой сделке дня, это, очевидно, исполнится. Но часто, если Вы покупаете на разрыве, Вы сделаете это точно около максимума дня. Так что есть некоторые специальные правила и предосторожности, когда имеем дело с разрывами. Правило это довольно просто, вот оно.

1) Всякий раз, когда акция показала разрыв на  $1/4$  или больше от нашей рекомендуемой цены покупки, ничего пока не делайте. Вы должны подождать 30 минут и отметить максимум для покупки, минимум для короткой продажи. Эту 30-минутную отметку Вам нужно увидеть преодоленной ценой. Так, для лонга по XYZ была заявлена покупка выше \$ 55. Акция сделала разрыв на  $55 \frac{1}{2}$ , так что Вы не делаете ничего. Через 30 минут торговли дневной максимум был  $56 \frac{1}{16}$ . Как только  $56 \frac{1}{16}$  будет пробит, Вам следует покупать. Рассмотрим короткую продажу ABCD, которую мы хотим инициировать, если она пойдет ниже \$ 25. Акция делает разрыв до \$  $24 \frac{11}{16}$ . Опять таки, ничего не предпринимаем, но наблюдаем за торговлей в течение первого получаса. Отмечаем минимум  $24 \frac{3}{8}$ , как цену, которую мы хотели бы видеть пробитой прежде, чем что-либо сделать. Если эта цена преодолена, мы будем входить в короткую продажу.

2) Второе правило разрыва связано с продажей открытых позиций. Если открытая позиция делает разрыв на \$ 1 или выше максимума предшествующих дней, активно искать возможности для выхода. Я приведу пример лонга, имейте в виду, что короткая - то же самое но наоборот. Когда Вы имеете акцию, которая сделала разрыв на открытии \$ 1 или больше, отметьте минимум первых 5 минут. Если эта цена пробита, продавайте половину вашей позиции. Следующая цена, которую нужно наблюдать - 30-минутный минимум, если и она преодолена, продавайте всю позицию.

3) В случае разрывов мы используем модифицированный стоп. Для лонгов стоп - на  $1/8$  ниже минимума с момента входа в позицию. Для шорта стоп - на  $1/8$  выше максимума дня входа в позицию.

## ПРОДАЖА

1) При краткосрочных сделках продайте от  $1/4$  до  $1/2$  вашей позиции, если Вы имеете рост \$ 2. Вы, конечно, можете "оставить на столе" большую часть потенциальной прибыли, но это правило делает для нас несколько полезных вещей. Во первых, оно удовлетворяет желание взять прибыль. Во вторых, и наиболее важно то, что это сохранит нас в деле для возможной большей прибыли. Оно работает лучше всего для больших счетов, но выгодно и для тех, кто торгует лотами всего по 200 акций. Следите за тем, чтобы не позволить оставшимся акциям соскользнуть в отрицательную область.

2) Не позволяйте \$ 2, или 5 %, или большему росту, превратиться в убыток. Это важно, потому что трудно найти акцию, которая движется в нужном направлении, и бывает очень досадно, если Вы позволите хорошей прибыли превратиться в лосс.

3) Если акция идет вверх на 20 % или больше за 3 дня, рассмотрите возможность оставления половины позиции на более длительный срок. Держите оставшуюся половину, пока акция пребывает выше 50-дневной простой скользящей средней, или ниже нее для короткой позиции. Помните правило N 2, не позволяйте ей превратиться в убыток.