

Diversified Trend Trading Approach (DTT)



Copernicus

DIVERSIFIED TREND TRADING (Strategia podążania za trendem z różnicowaniem portfela)

Post # 01

Kilka wytycznych dla tej strategii

- Różne strategie pasują do różnych osobowości. Strategia ta odwołuje się do tych którzy poszukują strategii podążania za trendem opartej na solidnym podejściu do zarządzania ryzykiem.
- Używam **IG Markets** jako że jest to moja ulubiona platforma w przeciwieństwie do MT4 dzięki znakomitemu zaawansowanemu pakietowi wykresów, które pomagają zarządzać zdywersyfikowanym portfelem, a także szeroką gamę produktów oferowanych przez IG, od par walutowych do indeksów i towarów.
- Strategia jest obecnie skonfigurowana do aktywnego monitorowania 24 produktów, wykres jest przyjazny dla użytkownika jego interfejs graficzny posiada wiele alertów handlowych. Działa dobrze na MT4, ale może stać się bólem d...y, gdy wymagana jest szybkość wykonywania operacji ale oczywiście to Twój wybór. Pomyślałem tylko, że wspomnę o tym, że z niego skorzystam.
- Nie udało mi się opracować EA dla tej strategii, ponieważ określenie trendu nie zależy od ramy czasowej, co utrudnia programowanie. Znaczące decyzje musi odbywać się na poziomie D1, W i M. Może znajdzie się utalentowana osoba, która zechciałby sprawdzić, czy da się przekształcić to w EA. Uważam, że podejście to będzie zawsze tylko półautomatyczne, w najlepszym razie biorąc pod uwagę dyskrecyjny charakter określania trendu i z mechanistycznym charakterem zarządzania.
- Pomimo braku sukcesu w opracowaniu EA, w miarę możliwości, usunąłem, ludzką dyskrecję na poziomie H1 TF.
- Początkowy SL jest zawsze umieszczany na każdym zleceniu, ale zaraz po jego ustawieniu to kanał odchylenia standardowego staje się mechanizmem wyjścia, więc rzadko osiągasz poziom swojego początkowego SL.. W efekcie upływający czas w trendzie jest Twoim przyjacielem, ponieważ każda świeca wzrostowa zmniejsza współczynnik strat. Kanał odchylenia standardowego jest używany do zarządzania trejdem przez cały czas jego trwania.
- Moją maksymalną tolerancją ryzyka jest 0,5% ryzyka na trejd, ale to nie musi powstrzymywać innych przed zwiększaniem tej wielkości, jeśli są przygotowani na wyższy współczynnik ryzyka: wynagrodzenia (R:R). Na przykład, ryzyko na jeden trejd równe 1,0% powoduje podwójne zwroty, ale również oczekuje skojarzonego podwojenia powiązanych parametrów ryzyka, takich jak obsunięcie kapitału. Naprawdę uważam, że takie podejście może poradzić sobie z agresywniejszym zarządzaniem ryzykiem w oparciu o aktualne wyniki, ryzyko dla trejdu na poziomie 1,00% byłoby uważane za całkowicie akceptowalne, ponieważ mało prawdopodobne jest abyś poczuł się zły zimnym potem.
- Dla DTT używam wykresu dziennego, aby potwierdzić trend używam kanał odchylenia standardowego (1.0 std dev), a następnie przechodzę ramę czasową H1, aby odtworzyć trend od momentu rozpoczęcia na D1, a następnie poczekać na przełamanie Kanału Donchiana (Donchian Channel breakout) lub wskakuję niezwłocznie, jeśli przełamanie wystąpiło używając Kanału Donchiana z 40 okresów na H1. Wiem, że nie poświęcam dużo czasu na omawianie poziomów wsparcia i oporu, które są kluczowym wymogiem dla trejdowania z trendem, ale właśnie tutaj

Donchian wchodzi w grę, wizualnie potwierdzając, że przynajmniej w krótkim okresie, po przełamaniu będziesz w niebie. Identyfikacja wsparcia i oporu jest kluczowym krokiem w analizie harmonogramu D1 w identyfikowaniu punktów wejścia i okresów konsolidacji, ale nie wydaje mi się, że muszę zajmować się tym aspektem w tym wątku, ponieważ istnieje wiele innych wątków, które lepiej to przedstawiają.

- Po (lub tuż przed) przełamaniu Donchian Channel na H1, natychmiast odświeżam kanał odchylenia standardowego od rozpoczęcia trendu (na D1) do świeczki bezpośrednio poprzedzającego świeczkę na której zajęto pozycję. Dolny lub górny kanał odchylenia standardowego (zależny od kierunku trendu) wyznacza początkowe wielkość $SL = R$.
- Jeśli osiągnę poziom zysku na poziomie $2,5 R$, odświeżam trend na wykresie H1, używając kanału odchylenia standardowego wynoszącego $0,5$ odchylenia standardowego, aby ograniczyć granice trendu i zapewnić, żeby zbyt wiele zysku nie zostało na stole przed wyjściem z rynku.
- Zauważ, że strategia ta nie odnosi się do poziomów High i Low w trendzie i ma tendencję do wejścia na rynek kiedy trend jest już dobrze uformowany i nigdy nie osiąga maksymalnego potencjału zysku.
- Korzystanie z tych zasad zapewni Ci zawsze trejdowanie zgodnie z kierunkiem dziennego trendu.
- Zauważ, że nie używam sygnałów Price Action jak pin bars, objęcia itp. Po prostu używam przełamania Kanału Donchiana na H1, aby wszystko było proste. Jest to konieczne, ponieważ doglądam duże portfolio i nie mogę sobie pozwolić na zbyt szczegółowe analizy trendów.
- Również, nie używam tradycyjnych szablonów (patternów) cenowych, używam wykresu barowego, w przeciwieństwie do wykresów świecowych, aby utrzymać porządek i czystość, szybko podejmować decyzje i unikać zaśmiecania mózgu za pomocą tej techniki.
- Zauważ, że używam kanału odchylenia standardowego w celu zdefiniowania trendu i nie używam klasycznej metodologii definicji trendu, sekwencji Highs czy Lows. Powodem tego jest to, że kanał odchylenia standardowego jest definiowany przy użyciu całego zestawu danych w przeciwieństwie do zaledwie 3 lub więcej punktów w trendzie. Podstawą tej metodologii jest to, że szukam spójnych trendów w całym zakresie czasowym, z którego korzystam. Pomaga to w walidacji tych trendów o charakterze bardziej regularnym, w przeciwieństwie do tych ruchów i trendów, które mogą być stroniczne z powodu kilku świeczek na wykresie. Ponadto wykorzystanie standardowego kanału odchylenia usuwa ludzką uznaniowość, która często występuje przy rysowaniu linii trendu. Na przykład pokazując ten sam wykres różnym osobom i często narysują one różne linie trendu. Tego się unika stosując kanał odchylenia standardowego pod warunkiem, że narysujesz kanały z najniższego punktu w trendzie do najwyższego punktu w trendzie. Innym powodem dla używania kanału odchylenia standardowego jest użycie go jako narzędzia regresji liniowej w celu określenia nachylenia trendu.
- W czasie trwania trejdu, zawsze odświeżam swój kanał odchylenia standardowego, gdy tworzy się nowy High (przy zleceniach kupna) lub nowe Low (przy zleceniach na sprzedaż). Istotne jest, aby po dodaniu nowych danych kanał odchylenia standardowego został odświeżony, ponieważ pozwala to zarządzać ryzykiem z postępowaniem trejdu.
- Zauważ, że korzystanie z kanału odchylenia standardowego działa skutecznie jako wskaźnik zmienności tendencji, tak jak ATR. Na przykład zmienność przed wejściem spowoduje pojawienie się szerokiego kanału standardowego odchylenia przed zajęciem pozycji. W rezultacie Twoje R będzie szerokie i obniży twoją wielkość pozycji na poziomie tolerancji na ryzyko.
- Straty są faktem życia, więc się ich spodziewaj. Na szczęście ta strategia ściśle zarządza tymi stratami i poprzez dywersyfikację zmniejszenia obsunięcia kapitału, więc niech strategia się nimi zajmuje nie próbuj tzw drugiego zgadywania. Trzeba pamiętać, że sprzedajesz silne trendy tylko

na wysokich ramach czasowych, więc momentum czynników fundamentalnych najprawdopodobniej doprowadza do tych ruchów w przeciwieństwie do przypadkowych zachowań rynkowych. Nigdy nie przewidujemy przyszłości i po prostu wskazujemy na bieżącej dzienny trend dopóki on nie zagnie.

Jeśli podejście to brzmi interesująco, zapraszamy Cię do tego wątku. Podobnie jak w standardowych ostrzeżeniach na innych wątkach, jest to tylko dla zainteresowanych członków, którzy chcą nauczyć się lub chcą pozytywnie i aktywnie w nim uczestniczyć.

Nie zamierzam publikować wyników testów wyników (ok okłamałem ... odnieść się do Postu 13), ponieważ jest to bezcelowe ćwiczenie. To będzie zadanie dla tych, którzy chcą samodzielnie handlować tą strategią. Mimo to, z moich własnych wyników testów, nie mogłem być szczęśliwszy i myślę, że ci, którzy zaangażują się w tę strategię również dojdą do tego wniosku.

Oto, co mogę ci powiedzieć. W ciągu ostatnich 688 dni kalendarzowych było tylko 450 możliwości handlowych w portfelu, co daje pojęcie, że strategia jest dość selektywna w swoich wejściach, a mianowicie z uwagi na konieczność zdefiniowania dobrej jakości trendu dziennego przed rozpoczęciem handlu kiedy wejście jest sygnalizowane. Dla tych, którzy nie mają cierpliwości czekać na te możliwości, ta strategia może im nie pasować.

Jeśli jesteś zadowolony z tego co tu przedstawiłem, informuję że wkrótce zacznę opublikować wykresy, aby rozkodować różne twierdzenia przedstawione powyżej. Pozdrawiam Copernicus.

Post # 02

20 Nov 2014

Będę używać ładnego długiego trendu na USDJPY, którym obecnie jadę jako przykład jakim. „Wygryzłem” z tego trendu dwa kawałki. Poniższy przykład definiuje ostatni przykład trendu, na którym wciąż jadę.. Należy zauważyć, że trendy tej wielkości nie są powszechne, ale pomagają one w celach objaśnienia strategii.

Wykres dzienny jest używany do określenia, czy istnieje trend (skutecznie filtr trendu), który może być dobrze zdefiniowany przez standardowy kanał odchylenia, jak pokazano poniżej. Zauważ, że trend zaczyna się 15 października i osiągnął najwyższy poziom w dniu 26 października, zanim się nim zainteresowałem.

Pamiętaj, że jest to najbardziej dyskrecyjna (uznaniowa) część strategii. Zakres zmienności dziennych świeczek w kanale odchylenia standardowego jest tym, czego używam w celu stwierdzenia, czy istnieje prawidłowy trend. Nie odpowiadają mi znaczne swingi wahające się w kanale odchylenia standardowego lub wyjątkowo wielki świeczki, które dominują w trendzie. To, co mi odpowiada, to kolejne uporządkowane świeczki w kanale, które oznaczają, że trend był obecny w całej sekwencji danych.

Niektórzy z was mogą sugerować, że nachylenie kanału odchylenia standardowego powinno być wykorzystywane jako filtr, ale z mojego doświadczenia wynika, że nie jest to rzeczywiście konieczne. Oczywiście te trendy z wyższym nachyleniem będą miały krótszy czas trwania, ale używanie nachylenia kanału jako filtru może wyeliminować znaczące trendy lub alternatywnie doprowadzić Cię do końca trendu, w którym występuje znaczna zmienność. Doświadczenie nauczyło mnie, że trendy kończą się

crescendo, a niektóre z największych, ale krótkoterminowych ruchów, to czas który określam jako okres kapitulacji dla tych trejderów, którzy stają się znacząco narażeni mając pozycje wbrew trendowi. Zdecydowanie wolę zajmować pozycję w już ustabilizowanym trendzie. Powodem tego jest to, że podczas bardziej uporządkowanych faz trendu kanał odchylenia standardowego jest węższy i w rezultacie wielkość twojej pozycji jest większa. Kiedy już jedziesz z trendem na dobrej pozycji i wchodząc w znaczną strefę zysków, końcówka trendu, gdzie często ekscytujące ruchy się zdarzają w kierunku trendu naprawdę robią z dobrego jeszcze lepszy trejd.

Korzystając ze kanału odchylenia standardowego (szerokość 1.0 std dev), określ trend przeciągając wskaźnik od Low do High. Zauważ zieloną poziomą linię, która została umieszczona na wykresie dziennym, aby po przejściu na H1, poziom był widoczny gdy zbliża się do niego cena.



Mój następny wpis pokaże obraz z ramy czasowej H1.

Post # 03

20 Nov 2014

Po ustaleniu, że mamy dobrze zdefiniowany trend przy użyciu kanału odchylenia standardowego. Na wykresie dziennym (powyżej), a następnie przechodzimy do wykresu H1, aby odświeżyć trend na H1 i poczekać na przełamanie Kanału Donchiana (40 okresowego). Zauważ, że wszedłem przed zieloną poziomą linią na H1, która została naruszona przez Donchiana.

Zajęcie pozycji było jednak spóźnione (po przełamaniu Donchian Channel), więc nie było doskonałe, jednak kropkowana żółta pionowa linia reprezentuje R i służy do określenia wielkości pozycji w trejdzie. Pamiętaj, że używam 0,5% ryzyka na kapitale, więc na koncie 200 000 USD, które stanowi maksimum ryzyka przy wejściu za 1000 USD. Linia przerywana jest zatem przekształcana w wielkość pozycji (po uwzględnieniu rozliczeń prowizji). W tym przykładzie nabyłem 11,8 mini lotów.

Zajęcie pozycji miało miejsce na 108.47 w dniu 29/10/2014 o godzinie 18:00, a SL ustawiono na 107.685. Poniższy wykres przedstawia zajęcie pozycji.



Post # 04

20 Nov 2014

W czasie trwania trejdu na kupno, w miarę pojawiania się nowych poziomów High, uaktualniamy kanał odchylenia standardowego (za każdym razem, kiedy pojawi się nowy poziom High) od rozpoczęcia trendu (najniższego Low) aby wprowadzić nowe dane (patrz przykładowy wykres poniżej). Odwrotnie postępujemy w sytuacji trejdu na sprzedaż.

Pamiętaj, że gdy osiągniesz zyski w wysokości $2,5R$, rysujemy inny kanał odchylenia standardowego, ponieważ im więcej danych to szerokość kanału zwiększa się naturalnie, a ty nie chcesz zostawiać zbyt dużo zysku na stole.

Zauważ, że jeśli trejd idzie przeciwko tobie, warunkiem wyjścia jest dotknięcie dolnego kanału odchylenia standardowego przez cenę. Ustaw alarmy w tym kanale, kładąc linię (żółtą) na kanale, aby podjąć działanie, jeśli zajdzie taka potrzeba.



Post # 05

20 Nov 2014

Trejd wygląda dobrze i osiąga zyski w przybliżeniu 2,5R. W tym punkcie odśwież kanał odchylenia standardowego o 0,5 szerokości, aby zawęzić kanał.

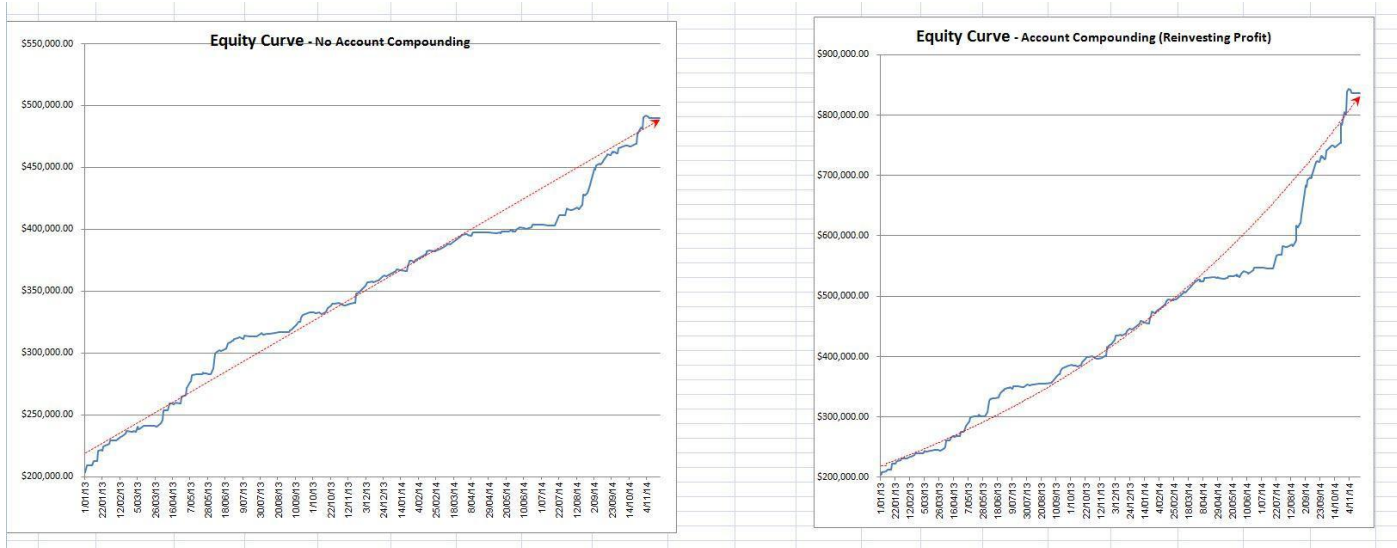


Następny wykres pokaże, jak bardzo zyskowny jest trejd obecnie.

Jesteśmy w chwili obecnej głęboko w zysku bez znaku, że trend się skończy. Zauważ, że jest to spektakularny trend, nie sądzę więc, by tak się działo za każdym razem. Jak widać, nie mamy założonego TP w tej strategii, ponieważ pozwalamy, aby zyski rosły i czekamy, aż kanał standardowego odchylenia zostanie naruszony przed zamknięciem. Daj znać, kiedy chcesz zobaczyć kolejne przykłady lub jeśli masz jakieś pytania.



Powodem, dla którego nazywamy system jako podejście zróżnicowane, jest handel 24 –oma instrumentami równolegle. Podstawową zasadą leżącą za tym jest trejdować wyłącznie znaczące trendy, a jednocześnie pomóc tym w osiągnięciu regularności strumienia przychodów. Spójność przychodów i minimalne straty są potwierdzone następującymi krzywymi dochodowości osiągniętymi od czasu rozpoczęcia testów na bieżący dzień / dzień (z wyjątkiem transakcji, które obecnie trwają). Należy pamiętać, że należy traktować je z sceptycyzmem, dopóki nie można potwierdzić podobnych wyników z własnego testu.

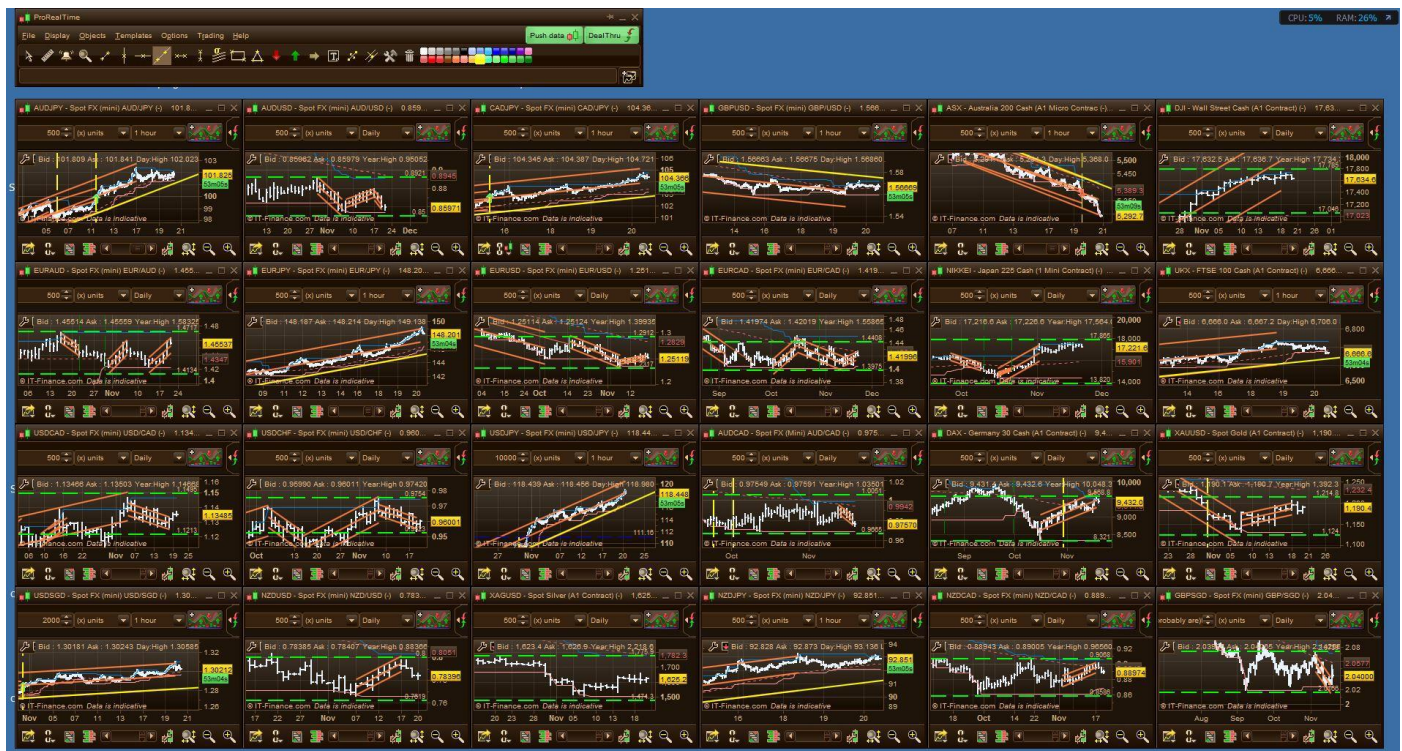


Opublikuję następne zdjęcie konfiguracji ekranu monitora w celu odzwierciedlenia różnicowanego podejścia.

Post # 08

20 Nov 2014

Konfiguracja wykresu jest kluczowa dla strategii. Nienawidzę tracenia okazji, więc transakcje mogą być zawierane w każdej chwili. Wszelkie alerty są zatem kluczowe dla strategii. Dla wielu z was styl życia 24/5 nie wchodzi w grę, ale zespół handlowców może tym skutecznie zarządzać.



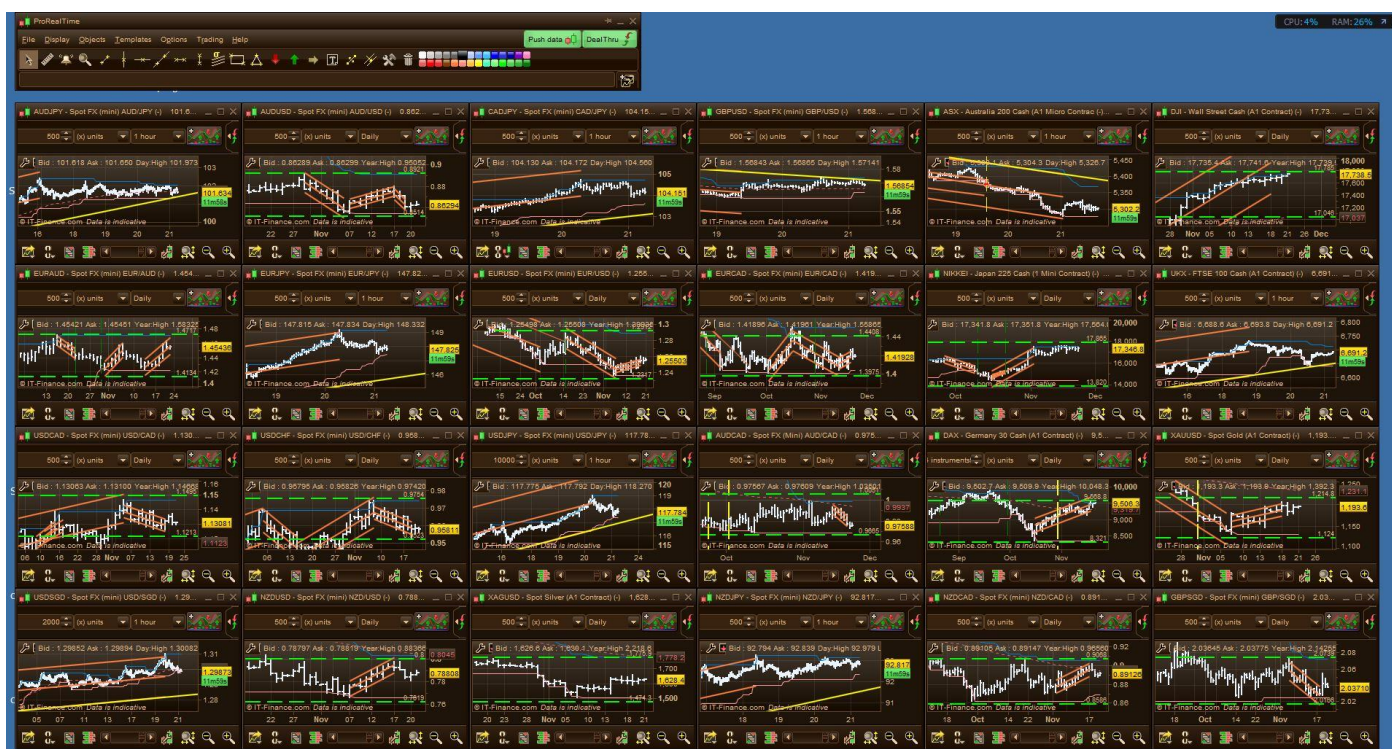
Witaj ponownie

Pomyślałem, że rozpocznę dziennik trejdingowy który uaktualniany przez codzienne ruchy zbliży nas do różnych interesujących aspektów swingu.

Dlatego będę przedstawiał streszczenie bieżących transakcji na żywo i warunki zajmowania pozycji, a następnie okresowo aktualizuje będę uaktualniał dziennik..

No to lecimy.

Poniżej znajduje się widok z 24 instrumentów, które obserwuję. Obecnie jestem w 9 aktywnych trejdach które są obserwowane i co do których mam pewne oczekiwania. Wykresy dzienne są w trybie oczekiwania i oglądania. Wykresy godzinowe są aktualnym rozwijającymi się trejdami.



Szczegóły dotyczące zawartych trejdów znajdują się poniżej.

Currency Pair	Lot Size	# Lots	Long/Yes	Entry Spread (pts)	Trade Entry	Trade Entry Stop	Entry Date	Entry Time	Trade Close Price	Close Spread (pts)	Close Date	Close Time	Trade Risk %	Trade Profit	Profit Pts	\$ Risk	Spread Pts Conversion	\$ per pt per 1Lot
EURJPY	0.01	87	TRUE	30	137.47	136.385	28-Oct-14	12:00		30			0.50%			-996.15	1000	\$1.00
USDJPY	0.01	118	TRUE	30	108.47	107.685	29-Oct-14	18:00		30			0.50%			-997.1	1000	\$1.00
NZDJPY	0.01	75	TRUE	30	86.3	85.02	31-Oct-14	3:00		30			0.50%			-1005	1000	\$1.00
USDSGD	0.01	75	TRUE	30	1.2846	1.27184	31-Oct-14	8:00		30			0.50%			-1002	100000	\$1.00
FTSE	0.01	109	TRUE	10	6593	6503.5	07-Nov-14	8:00		10			0.50%			-997.35	10	\$1.00
AUDJPY	0.01	75	TRUE	30	99.87	98.59	11-Nov-14	10:00		30			0.50%			-1002	1000	\$1.00
GBPUSD	0.01	41	FALSE	30	1.5768	1.60075	12-Nov-14	22:00		30			0.50%			-1006.6	100000	\$1.00
CADJPY	0.01	89	TRUE	30	102.715	101.65	13-Nov-14	21:00		30			0.50%			-1001.3	1000	\$1.00
ASX	0.01	158	FALSE	10	5376.6	5437.8	19-Nov-14	14:00		10			0.50%			-998.56	10	\$1.00

Przegląd zajmowanych pozycji zostanie przedstawiony w następnych postach.

R. C.

Startujemy z AUDJPY. Zauważ że jest to drugi trejd jaki bierzemy w tym trendzie, poprzedni rozpoczął się 23 października i został zamknięty z zyskiem po przełamaniu kanału 0.5 odchylenia standardowego.

W każdym razie, po wcześniejszym zamknięciu transakcji ten trend kontynuował ruch poziomy między 31 października a 11 listopada, sygnalizując, że nabiera oddech. Zielona kropkowana linia reprezentowała poziom, z którego chętnie rozważałbym zajęcie pozycji, jeśli trend ulegnie wznowieniu. W dniu 11 listopada dzienna świeczka rozpoczęła eksplozję w kierunku mojej strefy zainteresowania.



Przechodzimy na H1 w celu rozważenia złożenia zlecenia na przełamaniu Kanału Donchiana. Poniższy post dostarczy szczegółów dotyczących zajętej pozycji na ramie czasowej H1.

Zajęcie pozycji miało miejsce kiedy cena przełamała Kanał Donchiana na wykresie H1 tworząc nowe High w kierunku trendu z D1. Kanał odchylenia standardowego został od nowa narysowany od ostatniego znaczącego Low do High świecy poprzedzającej bezpośrednio nasze wejście w celu określenia początkowej odległości SL, aby określić (R) i wielkości pozycji. Szczegółowe informacje na ten temat można znaleźć w poście 17.

Teraz, na tym etapie można zadać pytanie, dlaczego kanał odchylenia standardowego przed zajęciem pozycji pociągnięty został do Low z dnia 16 listopada? W mojej poprzedniej transakcji powyżej zostało to omówione, był to punkt, w którym mój kanał odchylenia standardowego został faktycznie pociągnięty od następującego po tym, jak został zamknięty udany i bardzo opłacalny trejd i nie chciałem rozszerzać kanału do tego punktu rozpoczęcia, ponieważ znaczący składnik tego trendu został zakończony. Jeśli kanał został pociągnięty do 16 listopada, szeroki kanał spowodowałby znacznie większe R odpowiednie zmniejszenie rozmiaru mojej pozycji. Teraz nie jest to naprawdę problem, ale po znacznym zysku na pierwszym kroku

tego trendu byłem przygotowany na przeciwdziałanie. W tym celu należy jednak upewnić się, że szerokość i nachylenie kanału odchylenia standardowego jest wystarczające do tego ryzyka nie martw się, ponieważ czyniąc postępy w trejdowaniu tym systemem stanie się dla Ciebie jasne.

..... więc w tym przypadku zacząłem mój kanał od Low z 30 listopada 2014 r. i rozszerzony kanał do świeczki poprzedzającej zajęcie pozycji.

Gdy trejd osiągał nowe poziomy High, ciągle poprawiałem kanał odchylenia standardowego do najnowszego High i obserwowałem, że z upływem czasu kanał poszerzał się. Należy zauważyć, że ten trejd nie osiągnął 2,5R, w którym to momencie użyję kanału odchylenia standardowego 0,5 zamiast używanego obecnie kanału 1.0 kanału odchylenia standardowego.

Zauważ, że kanał ten rozciąga się do najwyższego High 16 listopada. Dopóki nie zostanie osiągnięte nowe High, jest to miejsce, w którym znajduje się kanał. Żółta linia nakładana na dolny kanał reprezentuje punkt wyjścia z trejdu. Ustaw ALERT na tej żółtej linii, aby upewnić się, że zamkniesz tam trejd. Jest prawdopodobne, że ten punkt wyjścia zostanie dotknięty bardzo szybko. W tym momencie zamknij trejd i ustawiasz wykres z powrotem w tryb wykresu dziennego oglądania i oczekiwania.



Post # 20

21 Nov 2014

Teraz do CADJPY. Po raz kolejny ta para walutowa znajduje się we wspinałym trendzie i zrobiłem wiele „ugryzień” a to „odgryzienie trendu” z dużym wynikiem wygranej na jednym z nich.

Poprzedni trejd został wprowadzony 11/11/2014 o godzinie 07:00 GMT + 1, ale rzut oka na niższy band kanału odchylenia standardowego wyrzucił mnie z zyskiem w wysokości 2,40 USD w dniu 13 listopada 2014 r., więc czekałem na możliwość ponownego zajęcia pozycji jeśli trend kontynuował swój ruch z zamiarem

rozszerzenia kanału odchylenia standardowego aby uzyskać możliwość rysowania kanału z powrotem od Low z dnia 4 listopada 2014.



Zwróć uwagę na zieloną linię przerywaną, która została umieszczona w celu potwierdzenia trendu przez jej przełamanie. Gdy cena rośnie w stronę tego poziomu zajęcia pozycji, poprawiliśmy wykres H1.

Post # 21

21 Nov 2014

Idziemy na H1.



Prawdopodobnie dociera do ciebie sens trejdów długoterminowych. Mamy teraz kilka transakcji na sprzedaż.

Post # 22

21 Nov 2014

GBPUSD pozwala na liczne transakcje sprzedaży od 15 lipca 2014 r. Oto bieżący trejd.

Wykres dzienny. Zauważ, gdzie jest zielona kropkowana linia, aby kontynuować ten trend.



Teraz na H1 aby zająć pozycję.

Post # 23

21 Nov 2014

Trejd z dnia 20 listopada 2014 r. O godzinie 14:00, niemal zamknięty, ale nadal żyje, aby opowiedzieć historię.

Zauważ, że nie przyjrzeliśmy się trendom na sprzedaż wcześniej, więc zdefiniowałem R na tym wykresie, aby zaznaczyć się z miejscem, w którym znajduje się Stop Loss. Jest to dokładnie odwrotny proces niż dla zajmowania pozycji w trejdach na kupno..



Post # 34

21 Nov 2014

Cześć Blackeagle,

Sprawdź na swojej platformie MT4 wybierając → Wstaw → Kanały → Odchylenie standardowe. Znajdują się one pod Wskaźnikami jak jest pokazane na zrzucie ekranu poniżej. W przeciwnym wypadku będziesz musiał poprosić o pomoc programistów tu na forum.



W odniesieniu do wejścia D1, jest najlepiej kiedy większość świeczek mieści się w kanale odchylenia standardowego. Spójność trendu jest kluczem przed zajęciem pozycji. Dlatego unikamy niestabilnych skoków niewielkiej liczby świeczek w kanale i szukamy spójnych świeczek, które potwierdzają, że mamy do czynienia z trendem. Kanał odchylenia standardowego określa również nachylenie, szerokość i kierunek. Jeśli masz wątpliwości, postępuj zgodnie z trendem przed wejściem na rynek. Trendy z dobrym momentum są tym, o co chodzi, pozwalają na późne zajęcie pozycji.

Dla mnie to nie jest wyścig, aby zobaczyć, czy mogę wejść w trend. Kluczem jest selektywność i upewnienie się, że mamy potwierdzony trend wzdłuż całej długości kanału. Oczywiście wypatruję ruchów cen, które wyraźnie leżą poza konsolidacją, sygnalizując, że nastąpiło przełamanie. Dlatego mam te zielone poziome linie na mojej liście obserwowanych wykresów w oczekiwaniu dostrzeżenia możliwości dla trejdu. Pojawia się wizualny ALERT, kiedy przełamanie ma nastąpić, gdy poziomy konsolidacji mają zostać przetestowane.

Teraz inna sprawa. Dokładne poziomy w zajmowanych pozycji nie mają znaczenia, ponieważ wiele przestrzeni dla ruchu zapewniają szerokie SL-e w tej strategii. Ważne jest jednak to, aby potwierdzony trend istniał przed zajęciem pozycji więc cierpliwość i selektywność jest kluczem nie za wiele pomocy dla programisty EA, ale mam nadzieję, że znajdzie się pomysł.

Niestety, filtr D1 jest aspektem uznaniowym systemu. Technika H1 nie jest uznaniowa. To, co chciałbym zaproponować, to skorzystanie z EA na MT4 (powiedzmy, że na bazie MACD) i iść do przodu na wykresie D1 w dłuższym okresie, aby doskonalić swoje techniki wizualnego poszukiwania potwierdzonych trendów. Od dawna zajmuje się tą strategią, a wejście D1 staje się drugą naturą ze względu na znajomość strategii.

Post # 35

21 Nov 2014

O cierpliwości i trzymaniu się strategii. Zauważ, jak blisko było aby zakończyć ten trejd. Jak w przysłowiu z pszczołami !!!!! :-)



Post # 36

21 Nov 2014

Trochę działań po otwarciu Londynu i Europy. Drugi kawałek trendu odgryziony.

D1



H1



...również na DAX (również drugi “gryz”)

D1



H1



Quoting Blackeagle

{quote} Mam dwa pytania: 1 - Czy masz regułę wskazującą, kiedy trend jest potwierdzony na D1? 2 - znalazłem parę wskaźników Kanału odchylenia standardowego dla MT4 i wszystkie one mają parametr „okres wstecz” lub opcję „ilości świeczek”, co oznacza, że musisz wybrać okres, w którym zaczyna się kanał i w zależności od liczby, zmienia się nachylenie kanału. Biorąc to pod uwagę, proszę wyjaśnić więcej "Korzystając ze standardowego kanału odchylenia (szerokość 1.0 std dev), określ kierunek od Low do High" Regards, Blackeagle

Dodam jeszcze trochę, Blackeagle.

Im bardziej myślę o tym, tym bardziej wierzę, że racjonalność użycia D1 jako głównego filtra jest następująca. Zasadniczo można by zastosować tę strategię używając wyłącznie ramy czasowej H1, ale nieuchronnie staniesz się zarozumiały, oceniając trend z kolejno mniejszą ilością świeczek czyli mniejszą ilością danych. Wykorzystanie D1 jako filtr trendu oznacza, że musisz potwierdzić trend mniejszą ilością świeczek D1 aby upewnić się, że schodząc na ramę czasową H1 trend jest dobrze ustalony w tym okresie czasu. Moim zdaniem ta metoda uniemożliwia powstanie skłonności do overtrejdingu.

Jeśli chodzi o drugie pytanie, najlepszym sposobem rozważenia miejsca wprowadzenia początkowego i końcowego kanału odchylenia standardowego przed wejściem jest następujący:

- Idealnie byłoby, mówimy tutaj o nowych początkach trendu, w przeciwieństwie do drugich wejść, które regularnie robię, kiedy zostałem wyrzucony się z głównego trendu, który ciągle trwa;
- Wystarczy spojrzeć na trejd kupna dla najniższego dolnego odcinka i rozpocząć standardowy kanał odchylenia od tego punktu. Następnie przedłużyć kanał do świeczki bezpośrednio przed zajęciem pozycji. Zapobiega to repaintingowi kanału na aktywnej świeczce: i
- Podczas trwającego trejdu (po zajęciu pozycji) nadal rozciągaj kanał odchylenia standardowego do najwyższego poziomu i zatrzymaj się. Za każdym razem, gdy powstaje nowe High, poczekaj, aż do chwili zamknięcia świeczki i przedłużaj kanał odchylenia standardowego do tego High. Zasadę odwrotną stosuje się do trejdowania w stronę przeciwną (przy zleceniach sprzedaży). Podczas trendu utrzymujesz te działania, ale co ważniejsze, gdy trend się rozwija, masz więcej miejsca do przestrzeni na zamknięcie trejdu, jak już jesteś głęboko w zysku, musisz ustawić kanał odchylenia standardowego na 0,5 szerokości. Wszystko to ogranicza kanał wokół większości punktów danych trendów, aby ograniczyć trend i przyczynić się do poprawy zysków. Oczywiście zmniejsza to również prawdopodobieństwo pozostania w trendzie przez dłuższy czas, ale w przeciwieństwie do podejścia typu millipede (pipsEASY) do kapitału lub strategii DIBS, ponieważ celem tej strategii jest generowanie regularnych dochodów w przeciwieństwie do strzelania w nieskończoną wydajność. Naprawdę podziwiam tych facetów, ale nie mogę tolerować takich obsunięć kapitału.

Ta strategia dotyczy Zrównoważonego Trejdingu dla osób chcących zarabiać trejdingiem na życie. Jasne jest, że aby zarabiać na życie trejdingiem stwarza się znaczne większe ryzyko w odniesieniu do wielu alternatywnych strategii handlowych mających na celu uzyskanie wyższego R: R. Usuń zabezpieczenia oferowane przez równomierny przepływ środków pieniężnych a z alternatywnego źródła i ta gra osiągnie nowy poziom.

Jak wszyscy wiemy, ci którzy korzystają z trejdingu, aby uzupełnić swoje dochody, mogą sobie pozwolić na znacznie agresywniejsze zachowania, biorąc pod uwagę, że ich dochody nie zależą od tego trejdingu. Dla wielu aspirujących trejderów te alternatywne strategie są nie dla Ciebie ale dla tych, którzy poszukują systemu mającego na celu ograniczenie obsunięć kapitału i zapewne oferować sprawiedliwy regularny przepływ środków pieniężnych, należy wziąć pod uwagę różne czynniki w strategii aby to osiągnąć.

Kluczem do tej strategii jest:

- Wystarczający kapitał obrotowy - zanim rozpoczniesz dążenie do niezależności finansowej, musisz być w ocenie wymagań kapitałowych. Obecnie, gdy ta strategia wygląda jak teraz, nie próbowałem nawet rozważyć pozostawienia jej jako głównego źródła przepływów pieniężnych bez co najmniej 200 000 dolarów kapitału obrotowego. **Pamiętaj, że ta strategia została przetestowana przez 2 lata i nigdy nie zakładaj, że jest to dokładny przewidywalny wynik jaki można nią osiągnąć** To nie powinno jednak powstrzymać nas od trejdingu tą strategią, ponieważ możesz wyznaczyć jako cel, wzrost kapitału podstawowy przy użyciu tej strategii przy jednoczesnym nie rezygnowaniu ze swoich pierwotnych przychodów ale może będziesz potrzebować zespołu handlowców, aby umożliwić trejding 24/5. Dołączono załącznik jako wyniki z działalności handlowej, zakładając 200 000 USD kapitału handlowego (bez kapitalizowania zysków). Średni miesięczny dochód wynosi około 13 000 USD, przy ryzyku wynoszącym 0,5%, ale nadal nie jest dość równy. Dokładnie przeczytaj ten arkusz kalkulacyjny (i uwagi), które można zobaczyć, dlaczego konieczne jest zróżnicowane podejście handlowe. Warunkowe formatowanie (w kolorze czerwonym) podkreśla te instrumenty, które były stratne w okresie miesięcznym. Spójrz na obecną sytuację finansową i sprawdź, czy takie warunki zaspokajają Twoje potrzeby. Z tego można uzyskać wskazanie kapitału handlowego, jaki jest wymagany do "Utrzymywania się z trejdowania".
- Minimalizowanie obsunięcia kapitału - strategia podążania z trendem z różnicowaniem portfela, zabłyśnie jasno kiedy ma się bezpardonowe podejście do zarządzania ryzykiem. Całą intencją oryginalnej strategii było uwzględnienie tego czynnika (a tym samym dywersyfikacja i ścisły nadzór na ryzykiem w wysokości 0,5%), dzięki czemu osiągnięto ten cel w sposób oczywisty. Zabezpieczanie kapitału jest tym co pozwala nam walczyć każdego kolejnego dnia jak też mieć spokojny sen (nigdy nie nocą jako trejder z Australii niestety) i trzymać rodzinę z dala od naszych pleców. Nie chwaląc się ... ale mam zamiar zrobić to mimo wszystko obecna strategia w ciągu ostatnich 2 lat osiągnęła obsunięcie kapitału poniżej 1% z najdłuższym ciągiem stratnych pozycji wynoszącym 5. nie można zagwarantować, że będzie to kontynuowane, bo nie może, ale prawdopodobieństwa jakie się kształtują, sugerując, że strategia ta jest dość solidna z zarządzaniem kapitałem. Przy okazji, maksymalna liczba zwycięstw pod rząd wyniosła 13.
- Rozsądny **System Quality Number (SQN)** dla typów analitycznych pośród tych, którzy lubią oceniać działanie systemu przy użyciu SQN opracowanego przez Dr. Van Tharp, obecna strategia z wielkością próbki 442 transakcji buja w „stratosferze”. Nie chcę w chwili obecnej podać tej

wielkości jako że wydaje się być nadzwyczajna i potrzebuję zewnętrznego, niezależnego audytu, który uzyskam, aby to sprawdzić, co mogę zrobić później z zainteresowanymi tą sprawą jeśli interesuje ich ta liczba.

- **Korzystny współczynnik Win / Loss** – (współczynnik zwycięskich do stratnych trejdów) wcześniejsze wersje tej strategii miały niższy współczynnik W:/L (około 50%), ale przy większej rentowności, jednak moim wyborem było dostosowanie strategii do filtra D1 w celu poprawy wskaźnika W/L, który przyniósł koszt .. ale biorąc pod uwagę moją strachliwą naturę, potrzeba regularnego przepływu dochodów i niewielkiego przyjętego ryzyka czyni mnie szczęśliwszym w ten sposób. Rezultatem jest aktualny wskaźnik Win wynoszący 65,8%. Zdaję sobie sprawę z niesamowitych warunków handlowych dla osób zajmujących się trendem w ciągu ostatnich 4 miesięcy, więc nie mam wątpliwości, że nie będzie to trwało długo. Cokolwiek, powyżej 50%, czyni mnie zadowolonym z spodziewanych wskaźników opłacalności.
- **Kanał odchylenia standardowego** - z perspektywy zarządzania ryzykiem narzędzie to było dla mnie darem bożym. Wiele strategii handlowych skupia się po prostu na wejściach w pozycję i wyjściach z pozycji nie martwiąc się tym, co jest pomiędzy. Kanał odchylenia standardowego to taki wskaźnik, który zapewnia, że trejding pozostaje na dobrej drodze na wszystkich jego etapach od zajęcia pozycji do jej zamknięcia. Rozszerza się również i zwęża odzwierciedlając zmienność na rynku i zarządza wielkością pozycji przy jej zajmowaniu. Co więcej, maksymalna strata w wysokości 0,5% jest uzyskiwana tylko wtedy, gdy na świecy nastąpi odwrócenie ruchu rynku. Tak może się tak zdarzyć .. ale to jest rzadkie zdarzenie. Biorąc pod uwagę, że wyjście z pozycji jest definiowane przez kanał odchylenia standardowego, który ma nachylenie współmierne do bieżącego trendu, ponieważ z każdą upływającą świeczką (H1), stop loss jest spychany w sposób naturalny w górę (taki jak przystanek końcowy) zgodnie z ruchem trendu. Co oznacza, że czas w trendzie jest Twoim przyjacielem. Tak, to trwa trochę czasu, zanim osiągnie się pozycję BE, ale warunek dla osiągnięcia BE nie jest arbitralną decyzją i zależy od prędkości, nachylenia i kierunku trendu. Ponadto kanał odchylenia standardowego oparty jest na historii cen i jako taki jest doskonałym narzędziem do oceny, kiedy trend się kończy i nadszedł czas, aby zamknąć trejd.
- 40 okresowy Kanał Donchiana - dłuższy okres Donchiana jest doskonałym narzędziem, jeśli chcesz poznać wizualnie, kiedy jesteś wolny jak ptak na błękitnym niebie, nie ograniczony przez krótkoterminowe bariery wsparcia /oporu. Oczywiście jest to tylko wizualne narzędzie wspomagające, ponieważ można używać go również aby odczytać główny trend, który można łatwo określić, kiedy wcześniejsze poziomy Low lub High zostały pokonane , a w przypadku zagrożonego wykresu są wspieranym narzędziem wspomagającym. Również, ale nie zawsze, przełamanie Donchiana zwykle towarzyszy zwiększone momentum, więc ustalanie zleceń oczekujących bezpośrednio nad Donchian Channel na H1 (przy kupnie) lub poniżej Donchian (sprzedaży) jest doskonałą techniką. Są bardzo przydatnym narzędziem gry na przełamanie (Breakouty). Używam ich również na D1 i rozważam je podczas umieszczania oczekujących zleceń na rozstrzygnięcie egzekucyjne, ale nie dogmatycznie na D1. Dzięki dłuższemu okresowi, 40-okresowy kanał Donchiana gapi się nam w twarz zarówno w czasie D1, jak i w H1, zmusza to do rozważenia wsparcia i oporu przed podjęciem decyzji o trejdie.

Należy pamiętać, że choć system okazał się imponujący, ta strategia została przetestowana tylko przez 24 instrumenty w ciągu ostatnich 2 lat i nie gwarantuje, że przetrwa próbę czasu ale z pewnością wygląda to dobrze. Myślę, że nadal potrzebuje pracy w usuwaniu uznaniowości w zakresie rozpoznawania trendu na D1. Gdy to zostanie osiągnięte, biorąc pod uwagę mechanikę wejścia H1 i zarządzania trejdem do końca,

chciałbym również założyć, że ma potencjał, aby EA powtarzało te osiągnięcia ale i to jest duża ale cała logika tego podejścia musi znaleźć odzwierciedlenie w EA najlepiej przy użyciu tych samych mechanizmów bez obejść programistycznych i dodawania złożonych wskaźników proxy, które próbują osiągnąć ten sam wynik to jest praca w toku i mam wątpliwości co do wyniku końcowego. Ponadto wcale nie jestem fanem optymalizacji. Logika handlu jest niezbędna, a nie optymalizowana. W perspektywie czasu, co może być nieco nieuczciwym stwierdzeniem, ponieważ faktycznie optymalizuję strategię, ale nie przez dopasowanie krzywej. Moje zmiany w realizacji strategii odnoszą się do decyzji w zakresie zarządzania ryzykiem, w przeciwieństwie do samych wyników.

Jeśli można by zaprogramować solidne EA, która spełniałoby logikę i integralność strategii, byłoby to również pożyteczna możliwość dokładniejszego testowania strategii. Ponadto pozwoliłaby nam skoncentrować się na niektórych potencjalnych dodatkowych filtrach, takich jak w EA Hanovera opartemu o relatywną siłę i filtry korelacji pod warunkiem, że mamy współmierne odniesienie poziomu instrumentów do handlu, aby utrzymać przepływy pieniężne)

.... to wszystko jak na teraz chłopcy z tą dogłębną recenzją.

Pozostawiam ten post i poddaję pod dyskusję
Happy trading.

Regards

Copernicus :-))

Post # 50

22 Nov 2014

[Quoting Blackeagle](#)

{quote} Dzięki za szczegółowe wyjaśnienie. Znalazłem kanał na MT4 (nigdy nie używałem Std. Dev. Channel) i pobrałem Donchian indisa z Twojego posta, ale problemem jest brak przełamań na H1, ponieważ wskaźnik Donchiana zawsze podąża za High i Low świeczki. Dołączyłem wykres USDCAD H1 z 40-okresowym Donchianem, a jak widać górna granica Donchiana podąża za poziomem (cena) High i Low granicą Donchiana, która spadła poniżej poziomu. W rezultacie nie widzę żadnych Donchian Breakout. Jakież komentarze? Pozdrawiam, Blackeagle {image} ...

Kanał Donchian, o którym mówiłeś, po prostu śledzi najwyższą (niebieską linię) lub najniższą niską (różową linię) akcj cenowe w wybranym przedziale (40 barów). Kiedy szukamy możliwości kupna, koncentrujemy się na niebieskiej linii, jej ruchu w górę. Kiedy szukamy okazji sprzedaży na czerwonej linii, jej ruch w dół. A breakout occurs when this horizontal line of the lowest low (for shorts) or highest high (for longs) is breached with a step up or step down. The chart below shows the donchian breakouts that have occurred over the course of the short trend on H1 for USDCAD. When the channel is breached, it signifies that price movement is making new lows or highs for the trend you are on.

Przełamanie występuje, gdy ta pozioma linia najniższego Low (w przypadku sprzedaży) lub najwyższa (w przypadku kupna) jest naruszona z znaczącym ruchem w dół czy w górę. Poniższy wykres przedstawia przełamania, które miały miejsce w ciągu krótkiego trendu H1 dla USDCAD. Gdy kanał zostanie naruszony, oznacza to, że ruch cenowy czyni nowe Low lub High poziomy dla danego trendu.

Zeszłego wieczoru skarżyłem się, że za późno zająłem pozycję, ponieważ brakowało mi przełamania, które nakreśliłem na poniższym wykresie. To nie jest duża sprawa, tylko że zgodnie z zasadami tej strategii, jest to przestępstwo Zauważ, że kiedy zdecydowałem się na sprzedaż, używając filtra D1, wszystkie poprzednie przełamania Donchiana, które oznaczyłem w tym trejdzie na sprzedaż, się skończyły. Przybyłem na miejsce (po przekąsce, kawie i cygarze) po ostatnim przełamaniu. Problem, którego nie ma żadne EA i jest ściśle związany z ludzką kondycją.

Aby wyjaśnić sprawę Kanału Donchiana, wyedytowałem wykres, odzwierciedlający te przełamania, którymi jestem zainteresowany oznaczono ptaszkami. W zrozumieniu kanałów Donchiana, w trendzie, musisz zdać sobie sprawę, że istnieje podstawowy trend i wiele wtórnych trendów na głównej ramie czasowej.

Przełamania Donchiana oznakowane krzyżem odzwierciedlają przełamania wtórnych (drobnych) trendów. W handlu głównym trendem interesuje mnie tylko niższy poziom niższego poziomu, dlatego należy uważać na identyfikację prawidłowego poziomu przełamania Kanału Donchiana.



Mam nadzieję że to jest sensowne... :-))

C

PPS Wskazówka dotycząca tej strategii Proszę spojrzeć na wykres powyżej. W oparciu o szerokość kanału odchylenia standardowego stwierdzono, że wykonywanie transakcji na jednym z poprzednich przełamania Donchiana byłaby stratą. Tutaj znajduje się kanał odchylenia standardowego i filtr D1. Z dość znacznymi wahaniami w tym trendzie nie chcesz wcześniej zajmować pozycji, ponieważ potrzebujesz czasu, aby zgromadzić więcej danych, dzięki czemu kanał odchylenia standardowego naturalnie poszerzy się z czasem reagując na większość zmian cen tj. 68% na 1.0 std dev, tych niestabilnych warunków. Dlatego warto zapłacić za użycie D1 jako filtra wejściowego, aby uniknąć wczesnego zajmowania pozycji w tego typu trendach. Jest również mądrze w takich warunkach, poszerzyć swój kanał odchylenia standardowego tak daleko, jak to tylko możliwe (w tym przypadku) głównego trendu. Jestem dość pewny siebie w związku z realizacją transakcji handlowej, jednak w teorii to nie byłaby najlepszy trend do handlu z powodu

zmienności w poprzednich historiach cen na tym trendzie wszystko powiedziałem z perspektywy czasu