

Торговая технология

для скальперского робота "Sigma"

Описание робота "Sigma" находится по ссылке <http://robot-scalper.ru/robot-sigma>

Определения

Которые необходимо знать и понимать, чтобы эффективно использовать робота "Sigma".

Сигма-отклонение: разница между текущей ценой актива и средней величиной своих предыдущих значений, за определенный период времени. Измеряется в пунктах.

Позиция: текущее количество купленных или проданных фьючерсных контрактов / лотов / акций. Если нет купленных или проданных активов и все средства находятся в деньгах, то позиция равна нулю.

Лонг: мы купили актив и держим его с целью взять прибыль когда цена вырастет.

Шорт: мы взяли в долг актив у брокера, продали его и ждем когда цена станет ниже, чтобы откупить его в прибыль.

Тейк-профит: заявка фиксирующая прибыль. (Заявка на продажу, выше цены покупки, если позиция Лонг. Заявка на покупку, ниже цены продажи, если позиция Шорт.)

Стоп-лосс: заявка фиксирующая убыток, если прогнозируемый положительный вариант развития событий не случился.

Торговая технология для робота "Sigma"

Торговая технология включает в себя **торговую стратегию** (алгоритм) и **правила** использования данной торговой стратегии.

Стратегия основана на ловле сильных отклонений цены от своих средних значений. Например, если произошло сильное отклонение на 300 пунктов, то мы делаем ставку на возврат цены в 150 пунктов (коррекция 50% к движению). Если отклонение сильнее, то ставку повышаем, а тейк-профит передвигается поближе, этим увеличивается вероятность его срабатывания. Нам главное как можно чаще закрываться в прибыль.

Важно понимать, что, чем меньше мы будем терять, тем лучше будет итоговая доходность. Убыток, который мы не получили, приравнивается к прибыли.

Поэтому первым делом рассмотрим ситуации в которых возрастает риск получения убытка и постараемся избегать их в нашей торговле.

- Торговать желательно на спокойном рынке, только в то время, когда цены укладываются в **нормальное распределение**.
- На открытии торговой сессии очень часто происходят гэпы (мгновенное изменение цены с разрывом), эта фаза рынка не укладывается в нормальное распределение цен.
- Торговать в это время данную стратегию не желательно.
- На вечерней сессии рынок очень вялый, волатильность снижается. В это время тоже лучше не торговать.
- В середине дня, на минутках, очень много шума и на рынке постоянно идет "пила" или "боковик". Стратегия предназначена для того, чтобы собирать вот эти движения вверх-вниз.
- Важно торговать только в середине дня!

Для этого в настройках добавлена возможность задавать **интервал торговли**. Можно выставить, например, с 10:30 до 16:30. В этом случае до 10:30 робот не будет открывать позицию. После 16:30 робот не будет открывать новые позиции, но закроет предыдущие, если такие были, чтобы не переносить их через ночь. Чтобы не брать повышенный риск. Если позиция не закроется до конца торговой сессии, то её нужно закрыть руками и выключить робота.

Эти и следующие рекомендации значительно повышают доходность данной контртрендовой скальперской стратегии.

Важные события:

Бывают торговые дни, в которые происходят запланированные **важные финансовые или политические события**. В эти дни выходит важная информация способная значительно изменить расклад сил на рынке. Это может вызвать мощные направленные движения. В такие дни желательно не торговать контртрендовыми роботами, так как чрезмерные направленные движения без каких-либо коррекций приводят к срабатыванию стоп-лоссов. Желательно просматривать **календарь событий**, например, в трейдерской соц-сети sMart-Lab. <http://smart-lab.ru/calendar/>

На Смартлабе также перед значительными событиями появляются тематические статьи. Так что, пропустить действительно важное событие довольно сложно, если хоть немного следить за этим.

Статистическое наблюдение 1:

по пятницам обычно доходность данной контртрендовой стратегии ниже, чем в другие дни, поэтому лучше её не торговать.

Статистическое наблюдение 2:

по праздничным дням (нашим и американским) обычно волатильность всего рынка очень снижается, поэтому лучше робота не запускать.

Суть торговой стратегии робота Сигма:

Чем сильнее и быстрее сигма-отклонение (отклонение цены от своих средних значений), тем больше робот делает ставку против данного движения цены.

Робот набирает позицию по мере развития сильного отклонения цены.

Например, у нас есть настройки:

1-я добавка: 1 лот при отклонении в 300 пунктов;

2-я добавка: 2 лот при отклонении в 400 пунктов;

3-я добавка: 3 лот при отклонении в 500 пунктов;

4-я добавка: 4 лот при отклонении в 600 пунктов.

В итоге, если цена отклонится на 300 пунктов, или чуть больше, от своих средних значений, то робот откроет позицию в 1 лот против движения цены. Тейк-профит может быть равен 150 пунктов. То есть, при обратном отскоке цены, в 50% от движения, робот возьмет прибыль и закроет позицию.

Другой вариант, если цена отклонится сначала на 300 пунктов, а затем на 400 пунктов, то робот сначала откроет позицию в 1 лот, а затем добавит ещё 2 лота. Позиция станет равна 3. Этим самым улучшая среднюю цену всех сделок. Тейк-профит при этом станет ближе к текущей цене и вероятность его срабатывания увеличится.

Аналогично, если движение будет более 500 или более 600 пунктов, то робот наберет позицию $1+2+3=6$ или $1+2+3+4=10$ лотов.

Запуск робота на сильном сигма-отклонении:

Если вы запустите робота в тот момент когда сигма-отклонение будет равно более 600 пунктов (актуально для вышеописанного примера), то робот сразу откроет позицию в 1 лот по текущей цене, затем добавит 2 лота, затем добавит ещё 3 и ещё 4. Так как все добавки удовлетворяют условию для набора позиции.

Поэтому желательно запускать робота когда сигма-отклонение не превышает значения указанного для второй добавки.

Медленное движение цены, без сильных сигма-отклонений:

Рассмотрим ещё один вариант развития событий. Если было сигма-отклонение на 300 пунктов и робот открыл позицию, но затем скользящая средняя догнала текущую цену и сигма-отклонение уменьшилось, то цена может продолжать медленно двигаться против нашей позиции. И если не произойдет сигма-отклонения на 400, 500 или 600 пунктов, то робот не станет увеличивать позицию. В итоге, либо на отскоке робот закроет позицию в прибыль, либо цена дойдет до стоп-лосса, после чего робот снова будет ждать сильные сигма-отклонения, чтобы открывать позицию. Произойдет своего рода перезапуск алгоритма.

Фиксирование прибыли:

Если робот набрал позицию, например, в 10 фьючерсных контрактов, то при отскоке цены робот зафиксирует прибыль от всех 10 контрактов. Но, если в этот момент сигма-отклонение будет больше значения для первой или даже для второй добавки, то робот снова частично восстановит позицию на 1 или 3 ($1+2$) контракта. При продолжении отскока робот снова возьмет прибыль. При развитии нового сильного сигма-отклонения робот будет наращивать позицию.

Управление позицией

Робот сам управляет позицией, сам подстраивается под текущую позицию при включении, сам инициализируется при запуске (выставляет и снимает заявку, чтобы появились значения в

таблице позиций по клиентским счетам). В общем, робот создан на базе эффективной торговой стратегии для максимально самостоятельной торговли.

Виды ценовых каналов и торговля в них

В горизонтально боковом ценовом канале 100% сделок закрываются в прибыль.

В восходящем или нисходящем волатильном ценовом канале большинство сделок будет закрываться в прибыль.

Фигура технического анализа «расходящийся треугольник», это ужас для дейтрейдеров, так как происходит множество ложных пробоев. В нашем случае, большинство сделок будет закрываться в прибыль.

Примеры того как робот торгует вы можете увидеть на сайте, в разделе статистика.

Расходящийся треугольник представлен в самом низу страницы и выделен для наглядности линиями.

<http://robot-scalper.ru/торговая-статистика-по-роботу-sigma>

Добавки

В настройках добавки реализованы следующим образом: 1-2-3-4. Итого, 10 контрактов. Если у вас депозит позволяет торговать, например, только четырьмя контрактами, то настройте добавки так: 1-1-1-1. Максимальный набор будет равен 4 контрактам. Как изменять настройки указано в руководстве пользователя.

Чем больше добавок, тем лучше. Вариант 1-1-1-1 гораздо лучше, чем 1-1.

Чем оптимальнее подобраны значения сигма-отклонений, тем лучше. Короткие отклонения лучше не использовать. Лучше пусть будет меньше сделок, но большинство из них будут прибыльные. Чем реже срабатывает стоп-лосс, тем лучше доходность торговой стратегии. Это основные моменты данной стратегии.

Итого, малое количество добавок приводит к быстрым стоп-лоссам; короткие добавки приводят к быстрому набору позиции и к значительному стоп-лоссу; слишком широкие добавки будут отрабатывать редко и не увеличат доходность.

Очень важно правильно оценить характер поведения инструмента: его среднюю и максимальную волатильность. На них и нужно закладываться, с небольшим запасом. Это можно сделать включая **динамический режим** в обычные торговые дни и посмотрев средние значения волатильности и значения добавок для сигма-отклонений.

Выбор количества лотов зависит либо от депозита, либо от риска, который вы на себя желаете брать.

Чем больше риск, тем больше потенциальная прибыль, но и просадки более значительные.

Чем больше количество добавок, тем лучше.

Одна добавка большой прибыльности не показывает.

Две добавки (1-1) уже лучше, чем одна, но пока ещё тоже говорить о высокой прибыльности стратегии не приходится.

Три добавки (1-1-1) — ещё лучше. Уже прибыльно.

Четыре добавки (1-1-1-1) — ещё лучше и ещё прибыльнее. Наилучший вариант из предыдущих. в итоге, чем больше добавок, тем выше вероятность закрыться в прибыль на коррекции (отскоке).

Максимально прибыльная комбинация, протестированная нами, это 6 добавок. Реализована она в тарифе **Премиум**.

Дальнейшее увеличение добавок приводит к непомерно возрастающему риску. В форс-мажорные дни, когда на рынке паника и происходят сильные движения без коррекций, убыток за один раз может равняться заложенному в настройках глобальному уровню потерь. Чего допускать крайне не желательно.

Вариант 1-1-1-1 — хороший. Это **консервативный** вид торговли.

Но, если выставить добавки 1-2-3-4, то тейк-профит, будет всегда подвигаться ближе, чем в предыдущем случае, так как **эффективная цена позиции** будет ближе к цене последней сделки из-за повышенного в ней количества контрактов.

Вариант 1-1-2-2 — это **умеренный** вид торговли (среднее между консервативным и агрессивным набором позиции). Если не хочется брать очень большой риск набором десятью контрактами, но при этом при увеличении позиции нужно чтобы тейк-профит был ближе и более вероятно сработал, то можно использовать такой вариант набора позиции.

Вариант 1-2-3-4 — **агрессивный** способ торговли, при котором вероятность срабатывания тейк-профита выше, чем в предыдущих вариантах.

Вариант 1-2-4-8 — это очень агрессивный способ торговли (называется мартингейл и/или мартингал). На четырех добавках основной вклад будут вносить последние две. Первые две, на большом диапазоне времени, будут настолько незначительны, что ими можно будет пренебречь. Имеет смысл использовать эти настройки только на очень больших сигма-отклонениях.

Рекомендуем для эффективной торговли использовать наборы либо 1-1-2-2, либо 1-2-3-4. Выбор зависит от размера вашего депозита и от риска, который вы готовы на себя брать.

Для инструментов с низким ГО добавки увеличиваются пропорционально выбранной системе:

1-2-3-4;

2-4-6-8;

3-6-9-12;

...

10-20-30-40.

Частичное исполнение заявок робот отлично обрабатывает. Проблем не должно возникать.

Рекомендуем НАЧИНАТЬ торговать с минимальным количеством лотов: 1-1-1-1.

На первом этапе вам важно понять данную торговую стратегию и не потерять деньги торгуя с повышенным риском.

И только после освоения робота и получения навыка уверенного пользования данной торговой стратегией можно увеличивать агрессивность торговли и прибыль.

Желаем прибыльной торговли!

© Робот Скальпер

<http://Robot-Scalper.ru>

<mailto:robot-scalper@mail.ru>