

“Торговля Временем” на АКЦИЯХ



Автор : Коровин Илья Анатольевич

Базовые предпосылки:

1. Рынок – это ХАОС.

То есть вероятность его движения вверх/вниз из любой точки =50%.

2. Рынок не прогнозируется,

а значит положительный результат в трейдинге определяется не прогнозом.

3. Секрет успешной торговли

заключен в последовательности правильных действий трейдера как при сбывшемся прогнозе, так и при несбывшемся.



1. Задача трейдера – получение прибыли, то есть совершение сделок с ПОЛОЖИТЕЛЬНЫМ РЕЗУЛЬТАТОМ.
2. ЛЮБОЙ результат на рынке формируется только одним – моментом **ВЫХОДА** из позиции.
3. Стандартный стереотип действий трейдеров при попытках прогнозировать рынок :
 - Прогноз направления (вероятность успеха = 50%).
 - Временное движение цены против прогноза.
 - **Стоп-лосс.**
 - Отрицательный результат по счету (вероятность получения в накопительном итоге=95%).

Вывод:

Использование **СТОП-ЛОССа** превращает временно несбывшийся прогноз (вероятность угадать 50%) в сделку с **ОТРИЦАТЕЛЬНЫМ РЕЗУЛЬТАТОМ**, которые убивают счета инвесторов в 95% случаев!

СТОП-ЛОСС = **ЗАКОНОМЕРНОСТЬ** убытка, превращение **БИРЖИ** в **РУЛЕТКУ**, в **НЕВЫНУЖДЕННОЙ** ситуации.

Кардинальное отличие биржи от рулетки :

Каждая ваша ставка всегда протяжена во Времени,
и при этом – биржевые колебания всегда амплитудны!

Практическое следствие:

Только на бирже есть возможность **ПОДОЖДАТЬ**
Пока ваш **неудачный** прогноз станет **УДАЧНЫМ**,
Пока сделка из **временно-отрицательной** станет **ПОЛОЖИТЕЛЬНОЙ**,



Иными словами, только на бирже вы имеете возможность

ОБМЕНЯТЬ ВРЕМЯ ожидания **НА ДЕНЬГИ**

(на движение цены в нужном вам направлении)

“Торговля Временем”

Это универсальные принципы успешной биржевой торговли на различных инструментах практически на всех финансовых рынках:

1. Работа **БЕЗ СТОП-ЛОССА**, то есть без взятия убытков.
2. Работа **БЕЗ** попыток **ПРЕДСКАЗАТЬ** рынок, то есть доступна практически каждому.
3. Прогноз влияет лишь на **СКОРОСТЬ** получения прибыли, но не на сам факт ее получения.



“Торговля Временем” на акциях,

это :

12 технических, торговых и психологических приемов,
призванных:

1. Сократить число временно отрицательных сделок, время их высиживания, размер части залипающего счета.
2. Увеличить число положительных сделок и время постоянного генерирования прибыли большей частью счета.



Принцип №1.
Работа без плечей и шортов.

1. При правильной постановке целей по прибыли (30-40% годовых) плечи – не нужны (0,15% в день в среднем можно делать и без плечей).

2. Плечи не дают возможности выживать счету не только в кризисы, но и в случаях временных снижений рынка всего на 20-30%.

3. Плечи создают постоянный стресс при торговле, что приводит к дискомфорту и массе не вынужденных ошибок трейдера.
Искусственное создание кризисных ситуаций.

4. Шорт= кредитное плечо по определению. Теоретическая возможность маржин-колла при любом размере шорта.
Потенциальная неограниченность роста.

Принцип №2.
Работа только на длинные деньги.

**1. Возможность длительного высиживания временных
противоходов рынка без необходимости принудительного
сокращения позиций в отрицательной зоне.**

2. Инвестиции или спекуляции?

- Вход в сделку в лонг без плечей.**
- Отсутствие стоп-лосса.**
- Терпеливое ожидание цели по прибыли.**

Главная цель – прибыль. Срок –вторичен.

**3. Новый подход к инвестициям. Инвестиционный скальпинг и
инвестиционный интрадей.**

Принцип №3. Принцип Диапазонной Торговли.

1. Флэт против тренда.



2. Разложение движения на флэты. Подавляющее время на рынке – флэты.

3. Выбор своего тайм-фрейма.

Поиск флэтов (диапазонов) в своем таймфрейме. Выбор величины прибыли на сделку, частоты и кол-ва сделок.

Принцип №4.
Работа только на качественных активах.

- 1. Уроза банкротства и делистинга при высиживании длительных падений некачественных эмитентов.**
- 2. Избегать работать с негосударственными и/или небольшими компаниями.**
- 3. Крупные государственные компании. Системо-образующие отрасли (сырье, энергетика).**
- 4. Товарные фьючерсы (металлы, сырье и т.д.). Индексы, Валюта.**

Принцип №5. Диверсификация счета.

1. Неоднородность рынка по секторам в одном периоде.



2. Развитие счета на 3-5 секторов с разным профилем рынка.

Принцип №6.
Кроссовая Торговля.

1. Выбор парных (сильно-коррелированных) акций :
 - Обычка-преф одного эмитента (Сбер/Сберпреф).
 - Единый сектор, аффелянты (ФСК/Россети) и т.д.
2. Отслеживание кросс-курса выбранных пар.
3. Вход в лонг по нижней акции в паре.
4. При падении : переход в кросс-курс (продажа верхней акции).
5. Высизживание кросс-курса в плюс.
6. Принцип двойного матожидания.
7. Шорт при парном трейдинге.

Принцип №7.
Размазывание секторов.

1. Разбивание лимита по каждому эмитенту на 4-5 равных рабочих части.
2. Размазывание входа. Сеточный принцип (разбавление).
Экспоненциальный принцип.
3. Фиксация прибыли на каждую часть отдельно.
4. Размазывание выхода :
 - по достижению границы диапазона
 - по цели прибыли
 - по трейлинг-профиту

Принцип №8.
ТА. Уровни. Точки входа и выхода.

1. ТА – не как прогноз, а как диагностика текущих состояний и определение логики действий внутри диапазонов.

2. Определение уровней диапазонов – исключительно графический анализ.

3. Точки входа и выхода (особенно важно при коротком тайм-фрейме и узких диапазонах) :

- правило круглых цифр
- объем в стакане (кирпичи и фанера)

Принцип №9.
Работа внутри флета.

1. Начало работы внутри флета с двух частей (одна часть на работу внутри флета, вторая – на выход из флета).
2. Логика уверенного Флета. Увеличение кол-ва рабочих частей после 3-4-х сделок внутри диапазона:
Принцип сохранения состояния.
Принцип заслуженного риска (рост прибыли - рост риска).
3. Увеличение лимита на эмитента при сохранении долгосрочного флета (после 4-5-и положительных сделок внутри диапазона полным лимитом).

Принцип №10.
Работа на выходе из флета.

1. Экспоненциальный принцип расставления заявок при входе из флета.
2. Ловля нового диапазона средними частями.

Принцип №11.
Размораживание залипших частей.

1. Правило общего плюса по рабочим частям. Совокупный плюс по залипшей и незалипшей части (частям) – дает право на размораживание залипшей части.

2. Правило общего плюса по секторам. Совокупный плюс по залипшему и незалипшему сектору дает право на размораживание залипшего сектора (с сохранением лимита торговли на этот сектор).

3. Правило раскрутки торговли с минимального лота на залипшем секторе:

- при долгой (в зависимости от вашего тайм-фейма) заморозке лимита.
- при выходе на устойчивый новый диапазон.
- при наращивании риска за счет раскрутки плюса (принцип заслуженного риска)

Принцип №12.
Психологическая устойчивость.

1. Внутренняя логика действий. Уверенность и готовность к любому сценарию.
2. Совершение только положительных действий по счету.
3. Терпение. “Кто умеет ждать – получает всё”.
4. Понимание временности просадок.
5. Концентрация на кол-ве акций.
6. Пренебрежение к рынку. Выключение стресса и виктимности.
7. Принцип Кнехта. “Я не знаю что будет, я знаю – как надо”.

Информация в интернете:

Ник:

Аллирог /Allirog

Сайты:

<http://mfd.ru>

<http://www.h2t.ru>

<http://smart-lab.ru>

Статьи:

“Все про миф о рыночных корреляциях”

“О вреде рыночных прогнозов”

“Торговля Временем”

“Воспоминания Биржевого Динозавра”

“Биржевой Успех - что, кому и как?”