Оглавление

14 Тактика скользящих каналов (СК) 2

14.1 Первое знакомство 2

14.2 "Окончательный вариант" 21

14.3 Тестирование тактики 27

14.4 Несколько замечаний относительно МТС 35

14.2 Отзывы и прочее, не вошедшее в предыдущие разделы. "Простая тактика Райана Джонса 38

И опять скользящие каналы. 48

**14 Тактика скользящих каналов (СК)**

**14.1 Первое знакомство**

Обсуждение этой темы заняло несколько месяцев, и еще не закончилось. Поэтому я буду излагать ее как бы в динамике, как выходили отдельные статьи, рассылка за рассылкой.

К технике, расписанной здесь, я шел несколько лет. В конце концов я пришел к четкому и конкретному шаблону. Кому - то это покажется очень простым. Что ж, колесо тоже простая вещь, а является величайшим изобретением человечества. В общем, такого, уверен, вы еще не читали.

Эта статья имеет очень важные рисунки, так что разрешите браузеру их нарисовать.

В свое время я открыл эту тактику для себя в период отчаяния и депрессии, и она смогла спасти мой счет и меня.

Позже, уверившись в своей "гениальности", я часто отходил от нее, экспериментировал, чаще всего это кончалось потерями, и немалыми. И сейчас я ищу различные тактики, все более изощренные, но, когда мой счет "проседает", возвращаюсь к ней, как к старому, испытанному средству. Вероятно, есть лучшие модели поведения на рынке, более эффективные, вся проблема в том, что я их пока не нашел.

Не смотря на все многообразие, все тактики можно разбить на две большие группы - ориентированные на отклонение от точки равновесия, и ориентированные на возврат к равновесию. Причем первых гораздо больше. Когда мы будем изучать индикаторы и осцилляторы, другие инструменты, увидим, что все они служат одной цели - дать сигнал о начинающемся движении. И все тактики, на них построенные, основаны на предположении, что цена рано или поздно двинется покорять новые вершины или низы. Более логично предположить, что, отклоняясь, как маятник, цена всегда стремится вернуться к своему равновесному состоянию, которое определяется совокупностью основных фундаментальных факторов, и, в силу этого, тоже меняется, но меняется медленно, не спеша, как средняя на недельном графике с периодом 55. (Следует признать, что средняя - весьма примитивная оценка, и не определяет линию, на которой расположены значения истинной цены, но, чаще всего, движется параллельно ей, выше, или ниже.)

Так вот тактика, основанная на ценовых каналах, как раз и относится ко второй группе.

В представленном ниже описании применяемой мной тактики много остается субъективного. Дело в том, что линии каналов приходится чертить трейдеру самому. На одном и том же отрезке графика каждый трейдер нарисует свои каналы. Попыткой формализации этой тактики был эксперимент с "канальной стратегией", где каналы строит графическая программа. Эта стратегия показала свою "неубойность", дала прибыль, но меня не устроила ее эффективность. Видимо недостаток ее в том, что строятся каналы опять же вокруг примитивной средней. Эта проблема не имеет тривиального решения, и я занимаюсь ею. Уверен, нас ждут еще интересные эксперименты. Но пока алгоритм построить я не смог. Да и хочется думать, что здесь справится только человек, трейдер, который работает своими ручками и своей головой, а не надеется на МТС и нейросети.

Итак - тактика "скользящих ценовых каналов" или "каналы Баришпольца"

Еще маленькое отступление - не спрашивайте меня о том, почему я выбрал именно такие параметры, а не другие, период, например, или размер стоп лосса. Попробуйте изменить параметры и "прогнать" по истории. Может получите и более лучшие результаты.

Торгуемая валюта EUR/USD (или любая другая, но с другими значениями стопов и поджатия)

Период графика 6 часовик

Используемые индикаторы - нет

Торгуемый лот - произвольный, но всегда постоянный.

Возможная максимальная серия убытков - 3, величиной 57 пунктов каждый.

Рекомендуемый минимальный начальный депозит - требуемая маржа + 1 800 (при работе с 1 лотом размером 100000 базовой валюты).

Эффективность - не менее 100% за месяц.

Графические построения - скользящие каналы. Каналы строятся по трем последним экстремумам - линия по двум низам и параллельная через вершину, или наоборот, линия по двум вершинам и параллельная по двум низам. Линии строятся ПО МАКСИМАЛЬНЫМ (МИНИМАЛЬНЫМ) ЗНАЧЕНИЯМ, то есть по теням свечей. Экстремум идентифицируется при не менее 2 свечек после его прохождения. Между соседними экстремумами не должно быть менее 2 свечей. Исключения - соседние максимумы - минимумы могут быть на концах одной длинной свечи.

Открытие позиции - при достижении границы канала - внутрь канала. Единственное возможное отступление - при наличии явного тренда можно не открываться против него. Оценивает сам трейдер. Потери при этом несколько уменьшаются, но часто пропускаются очень хорошие разворотные движения рынка.

Стоп при открытии - 57 пунктов.

Цель - противоположная граница канала.

При расстоянии от цены открытия 50 пунктов (в сторону профита) стоп переносится в точку открытия. Далее - поджатие на расстоянии 50 пунктов через каждые 10 пунктов. Возможно поджатие на расстоянии 30 пунктов, но это повышает эффективность незначительно. Поджатие производится только в сторону увеличения прибыли, но никогда - в сторону уменьшения.

При срабатывании стопа с убытком в 57 пунктов - открытие позиции в противоположную сторону с целью 57 пунктов. Принципы поджатия - те же.

Если после разворота цена опять разворачивается и опять достигает границы канала извне, закрыть позицию с убытком, не дожидаясь стопа, и перерыв в торговле две - три волны. (Не обязательное условие, но дает возможность успокоиться и переждать вне рынка флэтовый шторм, в котором такое и происходит.)

Все это может показаться на первый взгляд сложноватым. Чтобы Вы могли с этим разобраться, я попытался это все проиллюстрировать примерами.

Позже читатели указывали мне на обилие неточностей. Тем не менее, решил ничего не править, так как результат, эффективность тактики, не сильно зависит от точности входа в рынок, но - об этом позже.
Учитывая, что я далеко не художник, и пытался экономить на размерах файлов картинок, прошу простить за некоторый примитивизм. Графики строились в программе ArtStock, затем обрабатывались фотошопом. Открываю график, закрываю глаза и тыкаю пальцем. Палец уперся в август холодного лета 2003 года. Да, не самый удачный месяц для торговли, последние годы просто роковой для рынков и экономик.

Появилась возможность нарисовать канал по точкам 1, 2, 3. В точке 4 - покупка по цене 1350. Стоп - 1293.

На уровне 1293 срабатывает стоп с разворотом. Убыток 57 пунктов. Открыта позиция вниз со стопом 1350. При появлении белого доджа (помечен синим крестиком) корректируем канал по новым точкам - отмечены также синим цветом.

При прохождении цели после разворота (57 пунктов, помните?) 1236 начинаем "поджимать" профит сверху на расстоянии 50 пунктов от текущей цены, имея претензии на главную цель - границу канала. Но она не достигнута (чуть чуть) и позиция закрыта по цене 1170. Профит - 123 пункта, общий баланс + 76 пунктов.

На отметке 1205 продажа. Стоп - 1262. На той же белой свече срабатывает стоп с разворотом вверх. Убыток 57 пунктов. Баланс +19 пипс. Шаг вперед - два шага назад. Улыбаемся через силу.

Поджимая последовательно растущую прибыль через 50 пунктов, ставим стоп на уровне 1300. Так доходим до последней свечки. При этом оформляется следующий низ, и мы можем начертить новый канал (синии линии). Покупать не будем, и так уже открыты вверх. Что нас ждет дальше?

Цена "качается", но наш стоп на 50 пунтов ( а мы его двигаем вверх, когда возможно) задевает только на уровне 1375 свечкой, помеченно красной галочкой. Профит составляет 115 пунктов. Баланс - +134 пункта. Слабовато? Еще не вечер! Еще успеем взять большой минус! (шучу, конечно). После двух белых свечек рисуем новый канал по красным точкам. В синей точке на уровне 1325 покупаем.

Две белые свечки ложатся нам на душу бальзамом, но до границы канала (черная линия ) не доходят. В результате закрываемся на стопе на уровне 1375 (50 пунктов от максимума). Прибыль составляет те же 50 пунктов, всего депозит вырастает на 185 пунктов. Торгуем всего неделю. Бросить бы, снять деньги и уехать на Черное море! НА черной свечке "А" надо бы покупать, но к тому времени у нас уже новый канал - синий. Вот на его границе мы и покупаем по цене 1305. Стоп у нас стоит на уровне 1248. Свечка вниз не задевает нашего стопа, белая свеча не доходит до верхней линии синего канала, и закрываем позицию по поджимающему стопу на уровне примерно 1325. Профит 20 пунктов, а всего в активе +205. На маленкой свечке "B" появляется новый канал, зеленый, и при его пробое мы продаем по цене примерно 1335. Наше терпение оказалось вознаграждено, и мы закрываем позицию с профитом 107 пунктов по цене примерно 1228. Баланс + 312 пунктов. Тут же мы вынуждены покупать по той же цене - граница канала!

И, как оказалось, совсем не напрасно! на предпоследней свечке на этом рисунке появляется новый канал (черные динии) и мы вдруг видим, что достигли границы канала. Закрываем позицию на уровне 1328 и по той же цене продаем - граница канала. Положили в карман фигуру (сто пунктов). Баланс +412 пунктов. Что - то подозрительно гладко! Ничего, впереди еще грозный флэт, сколько депозитов на нем сложило головы!

Пока все на диво хорошо - длинная свечка вселяет оптимизм, мы накрываем прибыль стопом и на уровне 1270 нас "щелкает". Прибыль 58 пунктов. Всего 470. Жизнь - то стала налаживаться! Дальше - чехарда, смотрите внимательно. На свечке, помеченной синей галочкой, появляется новый канал - синий. И в красной точке покупаем по цене 1230. Стоп у нас на уровне 1173, он и срабатывает с одновременным разворотом вниз. Убыток 57 пунктов, баланс - 413 пунктов. Дальше мы "торчим" за дисплеем и пожимаем прибыль на расстоянии 50 пунктов через каждые десять. Так наш стоп оказывается на уровне 1125 (возьмем худший вариант, что закрыло нас на черной свече, третьей с конца. Хотя вероятнее это случилось на откате на белой), потом на уровне 1116, так как мы торопимся перенести стоп на нашу цель после лосса - 57 пунктов. Там наш стоп срабатывает, компенсируя прошлые потери. Баланс опять 470 пунктов. Мы ничего не делаем, пока на последней свечке не появляется возможность нарисовать новый канал - красный.

На следующей свечке продаем (синяя точка),но, так как мы подпирались в нулевой точке, то нас там и закрывает. Ничего, в зеленой точке мы опять продаем по цене 1110. Теперь уже короткие свечки нас не "выбивают из седла", и мы спокойно закрываем позицию в конце длинной свечки (так как она не достигла границы канала, то закрытие по стопу на отметке 1025, причем позицию не открываем, граница не достигнута! Прибыль составила 85 пунктов, всего +555. Что - то скучно становится...

А открываемся мы на следующей свечке, покупка по цене 960. Уже на следующей свече нас разворачивает по стопу вниз на отметке 903. Дальше очевидно - поджимаем растущую прибыль и на свечке "В"нас закрывает на уровне 846, компенсируя потери от предыдущего стопа. На свечке, помеченной синей галочкой, мы рисуем синий канал, и открываем новую позицию - покупкой - на уровне 830. Стоп снизу ставим на уровне 773, перенос в точку открытия - на уровне 880, затем поджатие, и на свечке "С" нас закрывает на уровне примерно 865. Профит 35 пунктов, совсем неплохо! Итого +590. Тем временем выстроился зеленый канал и мы продаем по цене 905 в красной точке. На свечке D нас закрывает в нулевой точке (мы успели перенести в нее стоп на прошлой свече), но мы опять упорно продаем по цене 880 на той же свече. И опять нас закрывает в нулевой точке на последней на рисунке свечке. Тем временем рисуется новый красный канал, и мы покупаем в синей точке по цене 820.

Цена так понеслась вверх, практически без откатов, что, поджимая ее на расстоянии 50 пунктов, подняли стоп до уровня 980. Там нас и закрывает на свечке А, профит составил 160 пунктов, а всего - 750. Еще действует красный канал, черного и синего еще нет, и, смешной случай!, приходится продавать в зеленой точке по цене 955 (какая разница, откуда достигнута граница канала!). Как оказалось - не напрасно. На следующей свечке вырисовывается черный канал, черная свечка так прошивает его, что мы успеваем перенести стоп четко на его границу и закрыться по цене 875. Опять прибыль 80 пипсов, а всего - +830. В той же точке нас открывает вверх, по стопу разворачивает вниз (я уже не рисую, сами посмотрите) на отметке 818, на отметке 760 мы компенсируем убыток, закрываясь по поджимающему стопу, рисуем синий канал, на его верхней границе продаем, длинная толстая свеча разворачивает нас вверх с убытком в 57 пунктов, но тут же возвращает их нам... Закончим на этом. Мы куплены с хорошими перспективами на будущее (сейчас то мы знаем, что первая неделя сентября началась сильным ростом евро).

Итог +830. Уменьшим его на 10 процентов - погрешности, спрэды,проскальзывания. Уменьшим еще вдвое - случайности рынка, просто проспали. Итого - 300 - 350 пунктов (за месяц). Оценивайте сами! Показаны неплохие результаты и на тренде, и при развороте тренда, когда большинство несет огромные убытки. Если начинали с депозитом 3000 - удвоение капитала за месяц. В общем - Сорос, да и Райан Джонс отдыхают!

Данная тактика не так проста, как кажется, но она реальна. Требуется достаточно прочные навыки в определении и нанесении каналов, обязательное действие, когда надо действовать, иначе единственное отклонение от правил (кроме тех случаев, где я оговорил отклонения), может привести к полному краху. Все это вырабатывается практической работой на демо счетах в течение, как минимум, нескольких месяцев, потом- на небольших реальных депозитах. Так как в данной методике 50% успеха зависит, все же от трейдера, должен предупредить:автор не несет ответственности за возможные убытки, полученные в результате применения его методики. Сами решайте - использовать, или нет.

Прошу обратить внимание на следующие важные условия:

Приведенный в описании тактики перечень правил - не пожелание, а свод правил, которые должны жестко (кроме случаев, где это оговорено) выполняться. Причем - все сразу. Невыполнение хотя - бы одного приводит к нарушению всей технологии.

Прежде чем применять ее на практике - необходимо несколько месяцев (хотя бы - 2) проверить на демо счете. Причем, проверять придется себя, в тактике - то я уверен, но вот сможете ли Вы лично выполнять все эти правила?

Меня спрашивают - почему я не всегда работаю по такой тактике? Она требует очень много сил и времени. То есть, даже на шестичасовом графике приходится сидеть за дисплеем с 6 утра до 0 часов. Только тогда можно ее выполнить. Что - ж, есть выходные и праздники, отдохнуть удается.

Есть также вопросы: а можно на 4 часовике, а можно с другим стопом и пр. Господа, я дал Вам инструмент из своего арсенала. Вы можете попытаться научиться им пользоваться и "делать" деньги. Вы можете посмотреть, как он устроен, и сделать для себя такой, как нравится. Подгонять его под вас я не буду. Когда изделие готово - все просто.

Теперь - построение каналов. Что понимать под экстремумом. Я его просто вижу. Есть две свечи ниже пика - новый максимум, обновляем канал. Все просто. Но - вторая свеча должно закончится! Как ни странно - это не критично. Я давал трем разным людям распечатки графиков за полгода. Они чертили скользящие каналы. Картинки, естественно, не совпадали. А вот результат у всех находился в пределах +-100 пунктов за месяц. Причем, у кого в одном месяце меньше - в другом - больше. К концу полугодия - примерно равный результат.
Объясняется просто - наличие системы всегда лучше ее отсутствия. Большинство из вас, уверен, так и не применяет стопы, и "улетает". Данная система этого не позволит. Подозреваю, что каналы можно даже отбросить! Просто открываться в любой точке, куда хочется, цель - пунктов 80 - 100, но дальше выполнять все правила со стопом с разворотом, с поджатием прибыли и пр. - и эта тактика будет давать не меньше 100 - 200 пунктов в месяц, и, во всяком случае, препятствовать уничтожению депозита. Но - не проверял.

Я советую тем, кто намерен попробовать эту тактику, внимательно прочитать и продумать все правила, нарисовать что - то вроде алгоритма своих действий, и жестко их придерживаться.

Уточним некоторые моменты:

Открытие позиции - при пересечении лини ДЕЙСТВУЮЩЕГО в данное время канала. Поэтому и приходится дежурить за дисплеем, а не поставить лимитник и уйти на рыбалку. Кроме того, ордер придется постоянно двигать, канал - то наклонный, и скоро брокер Ваш начнет брать с Вас деньги за постановку и отмену ордера - "задолбаете" приказами. Как быть реально, ведь граница канала - точка, а цена движется? Я беру зону + - 5 пунктов, попадает цена в эту зону - открываюсь внутрь канала. Причем неважно, откуда приходит цена, извне канала, или изнутри. Если цена на скорости пролетает эту зону - опоздал, сижу жду дальше.

Постоянно открыта ТОЛЬКО ОДНА ПОЗИЦИЯ. Открыли позицию - теперь все наши заботы - как ее получше закрыть. Новые не открываем. Естественно, величина торгуемого лота - произвольна, но постоянна в течение месяца, лучше - квартала. Не надо наращивать.

После открытия позиции сразу ОРДЕРОМ ставится стоп с разворотом на расстоянии 57 пунтов. Не раздумывая!

Растет лосс - ничего не делаем, все сделает ордер, если уж так получится.

Растет профит. При проходе 30 пунктов, если канал не изменился (тонкий момент!), ничего не делаем. Ждем. Действительно, какой смысл закрываться в точке открытия, если сразу же надо открываться в ту же сторону, открывались ведь на границе канала! Если канал изменился - переносим стоп в точку открытия. Теперь следим за ценой и поджимаем стопом прибыль через каждые 10 пунктов на расстоянии 50 пунктов. Щелкнет на откате - возвращаемся на пункт 1. Плавно достигли границы канала (действующего в настоящее время!), закрываем позицию, точнее - разворачиваем в обратную сторону. Проскочили на скорости (часто бывает) - если можем - ставим стоп на границу канала. (А не можем потому, что цена близко, и брокер не дает так близко ставить стоп). Здесь главное - постараться взять возможно большую прибыль при дальнейшем росте профита, но не упустить профит на границе канала при начавшейся коррекции против Вас. В общем - здесь надо определенное искусство, и поступать в зависимости от рынка.

Нас развернуло по стопу. Минимальная цель - 57 пунктов. Мои исследования показали, что если цена проходит такое расстояние, она чаще всего пройдет еще столько - же. Больше - очень редко. Так что, вернув убыток, и не наблюдая необычно сильного движения, лучше закрыться и отдышаться. Но если цена пролетела дальше - опять выжимаем. Опять - опыт и искусство, добывается тренировкой. Здесь главное - вернуть убытки, остальное - просто приз.

И никаких действий внутри канала! Это - очень важно!

работа над ошибками:

Данный раздел построен целиком по письмам и вопросам читателей. Но, прежде чем займемся непосредственно вопросами читателей, хочу акцентировать очень важную мысль: главное в этой тактике, как ни странно, не каналы, а жесткая система торговли. Много вопросов - как их строить. Уже говорил - не могу четко алгоритмизировать, иначе сделал бы давно программу. Я давно использую этот метод, но, когда решил рассказать Вам о нем, за пару часов попробовал формализовать эти построения. Очевидно - до конца не справился с этой задачей. Но пусть Вас это не смущает - как бы Вы не строили их, жесткая система торговли все равно "вытащит".

Теперь вопросы:
Поступили замечания от целого ряда внимательных читателей, обнаруживших ошибки в построении каналов. Да, вполне справедливо. На ту рассылку я почти "день" убил, немудрено - в нескольких местах ошибся. Предвидя это, я в конце и "ополовинил" результат. Вполне реальная оценка - 300 - 350 пунктов. Извините - все это проделывать заново не буду, очень утомительно, да и надо вперед идти. Принцип - то, надеюсь, все поняли?

Спрашивает Евгений...Обязательно ли чередование каналов сначала по двум максимумам и параллельно по минимуму, затем по двум минимумам и параллельно по максимуму, затем опять по двум максимумам и параллельно по минимуму. И не могли бы Вы выслать график с нанесенными каналами начиная с 22 сентября. Я сам начертил, но у меня есть сомнения в правильности. Если я правильно понял каналы обновляются при появлении новых фракталов ( по Вильямсу).

Наверное обязательно такое чередование, это ж естественный волновой процесс получается. Графики я высылать не буду (у меня их нет), я работаю (черчу) в on - line и нигде не записываю их. Насчет фракталов. Это более строгая фигура, часто экстремумы совпадают с ними. Но не всегда. Попробуйте, может это упростит построения. Все же я, повторюсь, часто отклоняюсь от формальных правил, при некоторой тренировке каналы сразу видны, при одном взгляде на график.

Спрашивает Дмитрий...После разворота по стопу цена почти тут же достигла из вне границы уже НОВОГО сформировавшегося канала и согласно данному правилу: Если после разворота цена опять разворачивается и опять достигает границы канала извне, закрыть позицию с убытком, не дожидаясь стопа, и перерыв в торговле две - три волны. (Не обязательное условие, но дает возможность успокоиться и переждать вне рынка флэтовый шторм, в котором такое и происходит.) нужно было тут же закрывать позицию. Т.е. получается, что не было смысла делать разворот. Или это правило относится не к последнему сформированному каналу, а к тому, на котором первоначально была открыта убыточная позиция?

Я не зря написал - не обязательное условие. Когда начинает "мотать" - я в произвольный момент обычно закрываюсь и делаю перырыв на день - другой. Но можно "вцепиться" и отработать все движения. Чаще всего общий итог не ухудшается (но и не улучшается значительно). Иногда правда удается "зацепить" мощное корректирующее движение. Так что сами решайте.

Спрашивает Александр... В описании тактики Вы пишите, что между соседними экстремумами не должно быть менее 2-х свечей. Однако на рисунке № 3 у Вас показаны экстремумы расположенные на соседних свечах. Объясните пожалуйста о каких экстремумах идет речь в описании о соседних максимумах или минимумах? Сегодня на практике опробовал Вашу стратегию и получил 200 USD профита, начало впечатляет.
Уже ответил выше. Меня тоже впечатляет и радует, что моя тактика Вам помогает.

Интересное письмо прислал Айрат. Огромное спасибо за подсказанную идею. Все каналы упростил до обычных горизонтальных уровней. Поджимаю на расстоянии 50 pts все профиты и лоссы. Прогнал по евре за три года. Результаты в 300 pts ежемесячно устраивают. Огромное спасибо.

Это иллюстрирует лучше всяких слов, сказанное мной в самом начале - не придавайте слишком большого внимания построениям каналов. Стройте - как нравится. Главное внимание - строгому соблюдению правил, образующих данный шаблон действий.

Подробнее остановимся на письме Андрея. Он обнаружил несколько важных ошибок в моих построениях, но дальше пишет:... Я взял наугад 2 месяца (мало конечно, но ведь приходится своими ручками работать, долго, но интересно самому рисовать) из истории разных периодов, и Вы знаете, получил ПРИБЫЛЬ!!! Самое интересное, когда чертишь каналы, второй раз, то на том же промежутке получаются другие каналы. А стратегия все равно приносит прибыль. Попробовал даже на часовых свечах (главное что бы разница между соседними экстремумами была не менее 12 часов) и даже более наглядно видно, как и когда срабатывают стопы.

Все ясно, по - моему, без комментариев. Спасибо за проведенную работу, важную для всех нас, за высокую оценку.

и далее Я вот только не знаю, кто сможет применить эту стратегию на практике. Полностью с Вами согласен, что мало кто правильно (точно) применит ее в работе на реальном счете. Мало кто может позволить себе иметь столько денег, что бы сутками сидеть дома (не работать на основной работе) и учиться месяцами зарабатывать на ранке форекс. Даже, что бы проверить эту стратегию на демосчете и то нужно целый квартал постоянно наблюдать за графиком цены. А затем еще нужны деньги для стартового капитала. Очень обидно, что необходимо потратить еще год, а то и два, чтобы накопить этот чертов капитал, а так уже хочется наконец-то стать финансово независимым …

А кирпичи на морозе класть легче? Я говорил - смогут все, но никогда не говорил, что это легко. Тяжелый напряженный труд. Но - в своем кресле, с чашкой кофе, без всяких начальников и пр.
С другой стороны, давайте посчитаем: упорно работая, скажем - года за полтора - два реально сделать миллион из десятки, даже из трех тысяч. Посчитайте сами. А дальше, купив квартиру, хорошую машину и все остальное, всю оставшуюся жизнь можно поигрывать пару дней в неделю "для удовольствия". Может игра стоит свеч? Или прозябать всю жизнь на "малых оборотах". Нет, по мне - так пусть "кости трещат и кожа лопается", но достичь своей цели в кратчайшие сроки и быть победителем.
И в третьих - часты, конечно, периоды, когда надо постоянно следить. Но не всегда. Можно "апроксимировать" пересечение цены и линии канала и выставить ордер на открытие. Сложнее всего - когда растет профит. Тут уж советую собраться и "выжать" все.

... Я тут, только-только стал применять свою стратегию и рад буду, если получу хотя бы 100% в год, а у Вас 100% в месяц. Может действительно, проблема в нас самих, и прошлое воспитание или опыт воздвигает перед нами барьеры и препятствия, которых на самом деле нет? И необходимо всего лишь решится, проявить волю и выдержку, пережить трудности - и все получится?!

Да, Уважаемый Андрей, и все мои уважаемые читатели. Именно так. Уверен - все у вас получится. Победите себя, и очень скоро 100% в месяц будете считать скорее как средний результат.

**14.2 "Окончательный вариант"**

" - это твое заднее слово?

- задней не бывает!"

разговор между Уэфом и дядей Вовой (Киндза - дза)

Было очень много вопросов с просьбой уточнить те или иные параметры, придать однозначность. Особенно - по построению каналов. Используя эту тактику, я полагался во многих узких местах на свой опыт и интуицию. И не учел, что в данном случае мой шаблон действий оказался не совсем удобен для применения другими, особенно начинающими, трейдерами. И я начал уточнять, опробовать, подбирать, все это съело массу времени. Честно говоря, рассчитывал на то, что читатели сами проделают для себя эту работу. Очень большую пользу приносит "проползание" по чарту, варьируя параметры, когда человек убеждается в надежности метода. Для меня это естественно, я частенько предпочитаю распечатать "чарт" и со старой заслуженной рейсшинкой поразвлекаться, расчеркивая его карандашами. Боритесь с собой, лень - не всегда двигатель прогресса.

Но многие читатели продвинулись еще дальше, чем я рассчитывал. И, к сожалению, в сторону усложнения. Начали добавлять сигналы индикаторов, кое - кто пытается уже построить МТС… Ну как же тянет все автоматизировать, чтобы за тебя торговал компьютер! "Вы что, и пирожные за меня есть будете? - Ага!" Дело ваше, конечно, но, не советую. Прелесть метода в его простоте, и незачем его усложнять. Есть замечательное изречение - "дайте человеку часы - и он правильно будет определять время. Дайте ему двое часов - и он всегда будет путаться."

С другой стороны - одно из важнейших условий успешной работы - вера трейдера в себя и в свою тактику. Вера - что бы ни случилось. Тогда используемая тактика "вытянет". В противном случае, при попадании в полосу проседаний, появляются сомнения в правильности тактики, поиски улучшений, ведутся попытки оптимизации параметров, причем, что самое вредное - не прекращая практической работы. Это не что иное, как попытка подгонки тактики под сиюминутное поведение рынка, которое может в любой момент измениться и "оптимизированные" параметры начнут давать дальнейшие убытки, хотя со старыми параметрами тактика в этом месте должна была устранить проседание и взять хороший профит.

Мы должны решить это противоречие, обратившись к опыту военных. У них есть закон - на этапе планирования операции, обсуждения - любые изменения, подгонки и пр., но, когда Чапай наиграется с картошкой и подпишет приказ, кто его (приказ) вздумает хоть чуть - чуть нарушить, будет беспощадно и жестоко наказан. Только так можно добиться успеха в бою.

Поэтому я призываю вас - ищите наиболее удобные и эффективные для Вас особенности тактики. И, прежде всего, подходящие к Вам лично, к Вашей психике, привычкам, режиму дня и пр., чтобы Вы могли эффективно выполнять принятые Вами правила торговли, не насилуя себя, получая от процесса удовольствие, и, конечно, профит. А когда найдете - прочь сомнения и страх. Верьте в себя и в свою тактику.

Сейчас я расскажу об окончательном варианте, к которому я пришел путем попыток формализации предложенной ранее тактики. Следует заметить, что я пытался решить две задачи - во - первых, выработать достаточно понятные, жесткие правила, охватывающие, по возможности, все вероятные ситуации, во вторых, сохранить эффективность системы на приемлемом уровне. Я никогда не буду торговать по такой системе, мне в ней будет "тесно", я оставляю себе некоторую свободу в некоторых элементах, то есть - при начертании каналов часто руководствуюсь общей картинкой, полагаюсь на свой опыт, Немного изменяю параметры стопов и поджатия при открытии по тренду и против тренда, иногда, при сильных трендах - вообще против него не открываюсь. Но у меня есть определенный опыт как в трейдинге, так и в применении данной тактики, а у многих из моих читателей его нет. Поэтому я даю средний по эффективности, простой, "неубойный" для депозита шаблон, изучив который в течение недели, "самый зеленый чайник" на реале начнет успешно делать деньги. И условие будет одно - абсолютная вера в метод.

Но я не устаю повторять - не верьте никому, и мне тоже, все подвергайте сомнению, верьте только себе. Как же тут быть? Да просто - лично "проползите" по всему графику, по каждой свечке, хотя бы с начала этого года и до сегодняшнего момента, запишите все профиты и лоссы, просмотрите спорные моменты на часовиках и, может быть, на минутках. Появилась уверенность? Не надежда, а спокойная 100% уверенность - открывай мини счет и тестируй с полгода, не меньше, прежде чем переходить на большой счет. Только предупреждаю - не читайте книжек по теханализу, не "шарьтесь" по конференциям в поисках чудо метода - просто выполняйте свою тактику. Не паникуйте в полосе неудач, не бросайте работу, тогда приз будет Ваш.

Итак - окончательный вариант - шаблон скользящие каналы.

Торгуемая валюта EUR/USD

Период графика 6 часовик

Используемые индикаторы - нет

Торгуемый лот - произвольный, но всегда постоянный, примерно равный: депозит\*100/3

Возможная максимальная серия убытков (показанная при тестировании) - 3, величиной 57 пунктов каждый.

Рекомендуемый минимальный начальный депозит -
(требуемая маржа + 6\*3\*размер лота/1000)\*кол.лотов

Эффективность - не менее 100% за месяц (в среднем, при оценке за период не менее полугода).

Графические построения - скользящие каналы. Каналы строятся по трем последним экстремумам - линия по двум низам и параллельная через вершину, или наоборот, линия по двум вершинам и параллельная по двум низам. Линии строятся ПО МАКСИМАЛЬНЫМ (МИНИМАЛЬНЫМ) ЗНАЧЕНИЯМ, то есть по теням свечей. Экстремум идентифицируется при не менее 2 свечек до и 2 свечек после его прохождения. То есть для максимума необходимо не менее 2 свечек меньше максимальной свечи до, и не менее 2 свечек меньше максимума - после. Расстояние между соседними экстремумами не ограничивается. Встречаются "групповые экстремумы" - две или даже три свечи с практически одинаковыми максимумами (минимумами). Идентифицируем их как один экстремум, линию канала проводим через верх (низ) правой из них.

Открытие позиции - при достижении границы канала - внутрь канала. При этом сигнал на открытие возникает при попадании цены в зону +-5 пунктов от линии канала. Количество лотов постоянно в течение месяца (лучше - всего квартала).

Стоп с разворотом при открытии - 57 пунктов.

Цель - противоположная граница канала.

Постоянно открыта ТОЛЬКО ОДНА ПОЗИЦИЯ (с выбранным числом лотов). После открытия позиции сосредотачиваемся на наилучшем выходе с рынка, для этого:

При расстоянии от цены открытия 50 пунктов (в сторону профита) стоп переносится в точку открытия. Далее - поджатие на расстоянии 50 (90)\* пунктов через каждые 10 пунктов. При приближении к цели величина поджатия уменьшается. Поджатие производится только в сторону увеличения прибыли, но никогда - в сторону уменьшения.

При плавном достижении границы канала (действующего в настоящее время!), закрываем позицию, и открываем новую позицию в обратную сторону. Проскочили на скорости - если можем, ставим стоп на границу канала. (А часто не можем потому, что цена близко, и брокер не дает так близко ставить стоп). Не можем - устанавливаем стоп максимально близко к текущей цене. Ждем, пока расстояние вырастет до 50 пунктов, и начинаем перенос по старой схеме. Теперь цель - примерно удвоенная ширина пройденного до этого канала.

При срабатывании стопа с убытком в 57 пунктов - открытие позиции в противоположную сторону с целью 57 пунктов (разворот). Принципы поджатия - те же. По новой позиции устанавливается стоп ордер без разворота на расстоянии 57 пунктов.

Если срабатывает второй стоп - перерыв в торговле два дня.

\* Я, обычно, при выраженном тренде, в направлении тренда поджимаюсь на 90 пунктов от текущей цены, когда цена проходит примерно середину канала - начинаю поджиматься на 50 пунктах, при проходе цели - границы канала - поджимаюсь на 30 пунктах. Против тренда - поджатие всегда на 50 пунктов.

Вот вроде бы все перебрал и уточнил. Неясных моментов, как будто, не должно остаться.

Для сильно занятых возможна работа посредством ордеров. Например - цена внутри канала. На следующие 6 часов мы ставим на верхней границе канала ордер на открытие позиции - продажу по цене А со стоп лоссом А+57 пунктов. Сразу же устанавливаем ордер на открытие позиции - покупку по цене А + 57 пунктов со стоп лоссом по цене А. Такую - же "конструкцию", но зеркально наоборот, соорудить на нижней границе канала. Но! Не советую расставлять такие ловушки перед важными фундаментальными событиями - обсуждением учетной ставки ФРС, напряженной предвоенной политической обстановкой и пр. (Вообще в преддверии таких событий лучше "постоять в стороне". Попытки сыграть на резких движениях, вызванных такими событиями, чаще всего приводят к значительным убыткам.)

После открытия позиции можно поставить Take Profit на противоположную границу. Необходимо также дождаться момента, когда сможете перенести стоп в точку открытия. После этого поснимать все старые ордера и спокойно ждать профита, поджимая его тогда, когда сможете добраться до дисплея (часто - пару раз в день).

В ряде случаев такой алгоритм снижает эффективность, но все равно она остается достаточно высокой. Тем более, что достаточно поглядывать на графики раз в 6 часов.

**14.3 Тестирование тактики**

Силами независимых экспертов читателей рассылки, исследовалась тактика СК с некоторымы отклонениями от параметров. Разброс был весьма велик, но в целом картина сложилась достаточно ясная. В таблице обозначены крайние отклонения от результатов (максимальный и минимальный).

Тестирование базовой тактики без отклонений:

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 51 - 56

Из них закрыто с прибылью - 28 - 40

Из них закрыто с убытком - 15 - 27

Общий профит (в пипс.) - 2223 - 3707

Общий лосс (в пипс.) - 855 - 1539

Общий баланс (в пипс.) - 770 - 2852

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 3 - 4

Тестирование базовой тактики, но стоп лосс 97 пунктов с разворотом

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 52

Из них закрыто с прибылью - 27

Из них закрыто с убытком - 19

Общий профит (в пипс.) - 2859

Общий лосс (в пипс.) - 1767

Общий баланс (в пипс.) - 1092

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 5 (!)

Тестирование базовой тактики, но стоп лосс 97 пунктов без разворота

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 36

Из них закрыто с прибылью - 22 - 24

Из них закрыто с убытком - 10

Общий профит (в пипс.) - 2099 - 2223

Общий лосс (в пипс.) - 930

Общий баланс (в пипс.) - 1169 - 1293

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 3

Тестирование базовой тактики, но стоп лосс 37 пунктов с разворотом

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 90 - 106

Из них закрыто с прибылью - 58 - 61

Из них закрыто с убытком - 31 - 39

Общий профит (в пипс.) - 4025 - 4171

Общий лосс (в пипс.) - 1147 - 1517

Общий баланс (в пипс.) - 2878 - 2654

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 3 - 6

Тестирование базовой тактики, но стоп лосс 150 пунктов с разворотом

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 52

Из них закрыто с прибылью - 29

Из них закрыто с убытком - 11

Общий профит (в пипс.) - 3398

Общий лосс (в пипс.) - 1650

Общий баланс (в пипс.) - 1748

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 2 Примечания: 1.Сумма прибыльных сделок и убыточных может не совпадать с общим количеством. Недостающие сделки принесли нулевой результат.
2. В спорных случаях решения принимались в сторону ухудшения результатов торговли.

В общем, как говорится, имеющий уши, да увидит! Несмотря на небольшое количество независимых экспертиз, отношусь к полученным результатам с высоким доверием. Они достоверны. И можно сделать несколько весьма интересных выводов.

Система торговли поразительно устойчива. Даже при значительном изменении параметров она дает приблизительно равные результаты.
И при всех исследованных отклонениях тактика приносила положительные результаты. (Депозит не уничтожается). Это - самый важный для нас вывод.

Некоторые эксперты говорили о необходимости увеличения стоп - лосса. Оказывается, наиболее привлекательные результаты показало тестирование со стопом в 37 пунктов! И, добавлю, более переносимые психологически серии лоссов (они просто малы). По мере увеличения размеров стопа результаты постепенно ухудшаются, и улучшаются при стопах в 150 пунктов. (Я тестировал и с большими - дальнейшего улучшения не происходит). Но многие из нас выдержат пару стопов в подряд по 150 пунктов?

Что полностью разваливает эту систему торговли? Во первых - непоследовательность. Какие - то сигналы на открытие выполняем, так как они совпадают с нашими ожиданиями, какие - то - пропускаем, слишком невероятно. Для обуздания хаоса рынка и придумана эта жесткая тактика, сетка, если будете варьировать на ходу ее параметрами хаос прорвется и уничтожит Ваш депозит. Таким образом, надо реализовывать каждый сигнал системы. Во - вторых - неверие. Когда после серии лоссов Вы откажетесь от нее и опять начнете сторожить момент, когда сможете сделать последнюю решающую ставку. Прошу Вас, не надо! Или продолжайте выполнять тактику, или уйдите от рынка на месяц - другой, отдохните, пополните счет. Проседания неизбежны, надо научиться их переносить.

Система устойчива настолько, что применять ее можно и при других сигналах на открытие - начиная от бросания монетки, кончая Аллигатором. И тогда она вытаскивает счет с профитом. Один из экспертов, Олег, писал, что пробовал тестировать следующее - каждый стоп с разворотом. То есть не только когда закрытие с убытком, но и когда закрывается с профитом. И такая система показала у него весьма высокую эффективность. Другой эксперт получил хорошие результаты, используя сигналы на открытие позиции, возникающие на графике крестики- нолики. Она (тактика) буквально заставляет трейдера быть все время в рынке и отрабатывать практически все значимые движения, а не мечтать у монитора о том, как наконец он поймает большую рыбу.

В заключение - одно замечание. Много присылают вопросов, связанных с закрытием позиции. Между прочим, это - один из краеугольных камней любой тактики, как взять от движения побольше, с минимальным риском для уже достигнутого? Я делаю так: никаких Take Profit ордеров! Ждем соприкосновения с границей канала с трейлинг стопом в 30, потом 15 пунктов. Если цена проходит границу и позиция не закрывается - ставим стоп прямо на границу и "отпускаем" цену пунктов на 50. Основная задача выполнена, начинается приз. Тут возможно творчество - можно просто закрыться и уйти пить пиво, можно отпустить цену на 100 - 150 пунктов и неделями выбирать затяжной тренд в 1000 пунктов, в общем - творите. Призом можно и нужно рисковать ради получения более весомого приза.

"Если я закрываю позицию на границе канала, должен ли я сразу открываться в другую сторону?" Конечно. Подходите к этому делу максимально пунктуально. Вы закрыли позицию, теперь ждем момента открытия. Этот момент наступил?(Цена на границе действующего канала) - открываем позицию. Не надо здесь творчества.

Ну, продолжим тестирование. Впечатлили результаты, полученные Сергеем, привожу их полностью:

Тестирование проводилось с 2 сентября по 23 октября 2003 г.

Валюта USD/CHF,

ГРАФИКИ - 4-х Часовики.

Стоп-лосс= 70 пунктов.

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 21

Из них закрыто с прибылью - 14

Из них закрыто с убытком - 6

(1 сделкa с нулевым результатом(стоп-лосс на точке входа)

Общий профит (в пипс.) - 3663

Общий лосс (в пипс.) - 420

Общий баланс (в пипс.) - 3243

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 2

Наиболее прибыльные периоды

с 4/09 по 26/09

с 16/10 по 23/10

Особенность - торговля только в направлении текущей тенденции, по направлению мувингов. И еще на графиках Артстока добавил MACD (в сомнительных ситуациях против него не открывался). Иногда помогает не входить на ошибочных сигналах с границ каналов. Ну что поделаешь, люблю я этот индикатор, уж слишком часто он останавливал меня перед рискованными решениями. Тем более, что в Артстоке в отличие от множества крутых программ, он меньше всего врет.

Бесспорно - выдающийся результат. Кстати, многие эксперты пишут о том, что вводят некоторые изменения в тактику. Это, конечно, нужно делать, и поговорим об этом в следующем выпуске рассылки.

Очень серьезно работает в этом направлении Дмитрий, мне понравился его сайт - советую взглянуть. Ему удалось описать тактику скользящих каналов для Омеги. Отчет Дмитрия полностью лежит здесь.

Дмитрий предупредил, что эксперта написал недавно, и тестирование только начал. Так что посматривайте на его сайт.

В общем тестирование показало, что тактика близка к идеалу механической системы - практически монотонно возрастающая прибыль со сравнительно небольшими проседаниями. Что тут еще можно комментировать?

Дмитрий прислал еще результаты за более ранние периоды. Так вот за 2001 год с теми же параметрами система дает очень много убытков. Это еще одно свидетельство того, что универсальных механических систем не существует. (В те годы я успешно работал на дневных графиках от одной границы канала до другой в направлении тренда, при этом стопы держал 300 пунктов, страшно вспомнить. При некотором размышлении я пришел к выводу, что в те годы для успешного выполнения тактики не хватало "размаха", то есть скачки по 100 - 150 пунктов, которые сейчас случаются почти ежедневно, тогда были сравнительно редки, средний древной "рейндж" (размах) был в пределах всего 70 - 90 пунктов. Естественно, после стопа с разворотом следовал опять стоп, в итоге - двойной убыток. Следовательно правы те, кто говорит, что рынок все время меняется, меняются и правила торговли.

Юрий тестировал на 4-х часовике (специально для тех, кто привык к Метатрейдеру), стоп сразворотом вместо 57 пунктов - 37, первое поджатие (перенос стопа в точку открытия) при отходе цены от точки открытия на 30 пунктов. Далее - поджатие на 50 пунктов, как в базовой схеме.

Получилось следующее:

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 135

Из них закрыто с прибылью - 62

Из них закрыто с убытком - 56

Общий профит (в пипс.) - 3704

Общий лосс (в пипс.) - 2072

Общий баланс (в пипс.) - 1632

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 8шт (однажды) и по 3 лоса четыре раза.

Наиболее прибыльные периоды

 27.05 по 02.06

с 11.07 по 22.07

с 08.08 по 20.08

Периоды максимальных проседаний

с 30.06 по 01.07

с 06.08 по 08.08

с 28.08 по 01.09

с 11.09 по 16.09 - 8 лосов!

Юрий также пояснил, что при срабатывании стопа с разворотом держал цель с профитом в 37 пунктов, чтоб вернуть убыток и на этом позицию закрывал. Как ему кажется, во многих случаях, если не закрыть такую позицию, то срабатывает стоп по открытию и теряется прибыль, т.к. после разворота редко когда цена уходит далеко.

Примерно такие же результаты получил и Андрей, также проверявших работу тактики на 4-х часовиках. При этом он применял базовые правила без отклонений.

Количество входов в рынок (открывалась позиция) всего - 126

Из них закрыто с прибылью - 64

Из них закрыто с убытком - 59

Общий профит (в пипс.) - 4830

Общий лосс (в пипс.) - 3363

Общий баланс (в пипс.) - 1467

Максимальная последовательность лоссов (шт) - 8

Наиболее прибыльные периоды

с 14.05 по 28.05

с 23.06 по 26.06

Периоды максимальных проседаний

с 22.09 по 29.09

Ну, пожалуй, закончим на этом тестировать. Картина в общем ясна.

Несколько замечаний по применению техники, появившихся у меня буквально в последние дни. Люблю образные примеры, прибегну к такому. Движение цены можно представить как траекторию шарика, катящегося по наклонному желобу, который еще качается из стороны в сторону. Края желоба - границы канала. Когда шарик выскакивает - он проходит сравнительно большое расстояние и попадает в другой желоб. К чему это я рассказываю - мы пытаемся определить границы нового желоба, используя точки предыдущего, из - за этого получаются тонкие и неправильные каналы, как результат - лосс сразу после сильного движения. Решается эта проблема двумя способами, причем - одновременно: при сильном движении не поджимаем цену близко, а пунктов на 100 - 150 (но конечно так, чтобы был профит), переждем консолидацию, находясь в рынке, чтобы взять продолжение этого движения. Может и не лучшее решение - часто не получится выбирать хорошее движение, будем отдавать при коррекции. Второй способ - после длинной свечи (шарик перескочил) не делаем ничего, пока не определились три экстремума ПОСЛЕ этой большой свечи.

**14.4 Несколько замечаний относительно МТС**

Как - то незаметно мы вовлеклись в бесполезное, с моей точки зрения, но требующее огромных затрат времени - занятие - поисками Святого Грааля (так трейдеры называют поиски "абсолютной" механической системы торговли, стабильно приносящей сказочно высокий доход). Бесполезной - потому что ее (такой МТС) просто не существует. Мы не будем здесь выяснять, почему не существует, и почему мы дошли "до жизни такой". Но некоторую ясность постараемся внести.

Существует два подхода к трейдингу - "механистический" и "аналитический". О них прекрасно написал, например, Джо ДиНаполи:

" Особенности технических приемов аналитической торговли:

Вы можете извлекать выгоду из чрезвычайно гибкого подхода к рынку

У Вас будет свободный персональный распорядок работы.

Вы получаете возможность быстро достичь больших прибылей (или убытков)

У Вас появляется потенциал чрезвычайно благоприятного соотношения выигрыш - проигрыш.

Существует абсолютная необходимость строгого управления самим собой.

Относительно небольшого капитала может быть достаточно для достижения поставленных Вами целей

Концентрация на относительно небольшом числе рынков не только приемлема, но и предпочтительна.

Особенности технических приемов механической торговли:

Плохое соотношение выигрыш/проигрыш правило, а не исключение

Методы тестирования, основанные на исторических гипотетических данных, как правило, по многим причинам очень ненадежные.

Большинство механических систем в конечном счете отказывают.

Необходимо одновременное применение множества систем на нескольких различных рынках, чтобы сгладить кривую капитала.

Необходим относительно большой капитал … для неизбежных проседаний.

Очевидно, что аналитический подход больше подходит независимому, "мелкому" инвестору, в то время, как механический - средним и крупным инвестиционным организациям.

Однако применение "чисто" аналитического подхода быстро приводит к полному краху не только начинающего трейдера, но и более опытного. В чем тут дело? А в том, что абсолютное большинство понимает аналитический подход, как торговлю вообще без четких правил, без разработанной стратегии, как свободное творчество. И раз за разом рынок показывает несостоятельность такого безответственного подхода к делу, и все напрасно.

Трейдер должен иметь четкую систему торговли, но не МТС. Как же быть? Как соединить достоинства обоих подходов, компенсировав их недостатки? Один из путей решения этой проблемы я предложил в своей тактике скользящих каналов. Там есть абсолютно четкие, недвусмысленные указания и запреты, но, в то же время, достаточно свободы, приближающей эту тактику к аналитическому методу.

Где же эта свобода? В определении момента и направлении входа в рынок. Построение каналов довольно субьективно само по себе, и мои попытки формализовать этот процесс существенно уменьшают эффективность, низводят до уровня добротной механической торговой системы. Приобретение опыта в построении каналов, интуиция, применение каких - то других дополнительных сигналов (от, например, излюбленных индикаторов), может резко уменьшить убыточные серии сделок. Но и на это у каждого трейдера должны быть какие - то четкие правила (образно говоря, надо предусматривать механизм, который будет давать Вам хорошего пинка, когда Вы забоитесь войти в рынок). Развивая эту мысль дальше, мы придем к тому, что и каналы то здесь не обязательны! Нужны недвусмысленные сигналы входа в рынок, хотя бы, например, в 12 часов бросить монетку, орел - бай, решка - селл. Некоторые из таких систем, практически весьма полезных и прибыльных мы рассмотрим. Обратите внимание, как мы пришли к выводу, о котором я говорил в самом начале - торговать очень просто!

Вот так торгуя, все и проигрывают. А чтобы не проигрывать, а даже наоборот, заработать на хлеб с маслом (и икрой), действия нужно уложить в жесткую схему. Ее определяет порядок выхода из рынка. Вот эта часть тактики должна быть абсолютно жесткой, и выполняемой четко, быстро, без сомнений. Сюда входят обязательный стоп лосс, действия при росте убытков, действия при росте прибыли. Вот если взять, например, те правила, что я описал в тактике СК, и соединить с любой системой, дающей хотя бы равновероятное соотношение прибыль/убыток, получится хорошая торговая система. О некоторых, повторюсь, поговорим в следующих выпусках рассылки.

Вы можете эти правила доработать "под себя", очень неплохо о них рассказано в статье,предложенной Алексеем, или, как он подписался "Crazy Gluk AKA Bass". Статья эта взята с сайта http://www.tradingclub.ru/. Сохраните эту статью в своей электронной библиотеке.

**14.2 Отзывы и прочее, не вошедшее в предыдущие разделы. "Простая тактика Райана Джонса**

От темы скользящих каналов не уйти, похоже, еще долго будем обсуждать различные аспекты этой тактики. У всех торгующих трейдеров еще свежи впечатления о резком подъеме Евро на прошлой неделе, для многих - неожиданного. Я, честно говоря, предполагал что - то вроде этого, так как на дневном графике четко виден треугольник, в котором они (EUR/USD) и борются. Некоторые коллеги писали о том, что тактика "плохо сработала", у кого дала всего 20 пунктов прибыли, у кого - всего 120, и это при движении почти 400 пунктов. Замечу, что всегда, глядя на уже свершившиеся затяжные тренды, возникает ощущение чемодана денег, проехавшего мимо. Не поддавайтесь этому чувству. Знаете, сколько трейдеров на этом движении потеряли полностью свои депозиты? И я не знаю. Могу лишь уверенно утверждать, что не менее 80 процентов трейдеров были проданы примерно на 1500, и у двух третей из них не стояли стоп лоссы. Где они теперь? А я не располагаю ни одним письмом, где бы наш коллега, выполнивший требования тактики, потерял депозит или, хотя бы, получил значительные убытки. Ни одним!

Зато есть другие письма. С согласия автора одного из них, Сергея Кузьмина, приведу почти полностью его интереснейшее письмо:

"Хочу рассказать о результатах тестирования канальной стратегии. Это очень наглядный пример того, в чем состоят настоящие проблемы. Не в системе, а только в нас самих.

Тестирование было за последний месяц, в реальном времени, в Argo, с учетом всех комиссий и спрэдов.

Результат таков - 122 пипса.

При этом 170 пипсов упущено из-за того, что я нарушил работу системы, закрывшись раньше времени (жадность меня съела).

Еще около 300 пипсов не получено, потому что я испугался войти в сделки, на которые указывала система (страх одолел).

Итого, при моих "грубых" вмешательствах в работу системы, она все равно вывезла результат с прибылью. Но если бы не мои страх и жадность, то результат был бы 600 пипсов в месяц.

Очень наглядно и впечатляет. Можно даже дать этот пример в рассылку, чтобы другим было наглядно, где мы сами теряем возможность получить прибыль. И насколько теряем!!! А также это показывает, насколько система устойчива к нашим ошибкам."

Я попросил Сергея уточнить параметры тактики, по которой он торговал, и Сергей любезно дополнил:

"Фактически никаких отклонений не было. Единственная поправка на спрэд (5 пунктов). Т.е. открываясь, к примеру, по 1,1510 на покупку (ask), я ставил стоп 1,1450 (потому что закроет по bid). 62 пункта (57+5) мне было считать лень, поэтому я округлил до 60. А потом у некоторых компаний спрэд 4 пипса, так чтобы не мучиться. В случае срабатывания стопа тут же переворот в другую сторону. За этот месяц ни разу не было двойного лосса подряд. Правда в одном случае после переворота я просто забрал прибыль по профиту чуть больше лосса (72 пункта). А так все же я предпочитаю даже после переворота поджимать стопом снизу, потому что иногда рынок может круто уйти. Обидно видеть это.

Постройка каналов классическая. Для формирования новой точки экстремума - минимум две свечи подтверждения. Новый канал строится тут же, как появляется такая возможность.

Но очень важный момент, на собственном опыте хочу предостеречь читателей рассылки. Пока сделка не закрыта, не открывать новую, даже если цена дошла до границы канала. Я думал схитрить. Если цена пойдет обратно, я дескать закрою первую позицию на обратном откате, а вторая уже будет давать прибыль. Фигушки. Два раза я так сделал. В итоге цена проскакивала границу. У меня открыты две позиции в противоположном направлении, я, конечно, ничего не теряю при этом, но и не получаю. Т.е. за два раза я упустил прибыль в размере 120 пунктов, потому что естественно меня закрывало по переворотному стопу.

Таким образом, сначала должна закрыться одна позиция. И только потом, если цена вновь дошла до границы канала, открывать новую. Потому что к этому времени либо канал изменится, либо тренд выдохнется. Так что правило нарушать не нужно. Одна позиция.

Закрытие классическое - перенос в точку открытия, когда цена прошла 50 пипсов. И затем просто поджатие на 50 пипсов. Здесь тоже есть некий нюанс. Считать нужно по соответствующей цене. Если позиция на покупку, то 50 пипсов вычитаются из максимально достигнутого bid, а если позиция на продажу, то 50 пипсов прибавляются к минимально достигнутому ask Например в пятницу была классическая ситуация, когда рынок якобы хотел уйти ниже 1,17, но он не дошел 1-2 пипса до стопа по bid, а затем снова пошел вверх.

Но главное - это показатель большой устойчивости системы. Несмотря на такие выкрутасы, нарушение правил, она все равно гонит прибыль. Чисто логически это понять невозможно. Но с другой стороны система позволяет на хаотическом рынке действовать систематически. И только наши страхи мешают работе системы.

Кстати, я подумал, что возможно сложность построения механической системы, а быть может и невозможность в том, что невозможно задать алгоритм построения канала. Несмотря на вроде бы четкость правил, остается некий неуловимый момент, когда ты все-таки решаешь построить канал так, а не иначе. Причем здесь важно, чтобы каналы строил один человек. Потому что в этом случае он сонастроен с системой. Другой человек также может построить свои каналы (они будут другие, конечно). Но должен соблюдаться принцип последовательности. Работать по своим каналам.

Я когда тестировал с мая по сентябрь, четыре раза проходил этот отрезок, строя по большей части, разные каналы (конечно, в некоторых местах они совпадали). И тем не менее, результат за 5 месяцев вышел сходный. Если же мы попытаемся взять из разных систем якобы только самое лучшее из них, создавая механическую систему, мы уберем некий балансир. Потому что должен соблюдаться некий баланс хорошего и плохого. И когда хорошего станет слишком много, система перестанет работать и станет убыточной.

Т.е. я хочу сказать, что когда человек сам чертит каналы, то он вносит этот элемент "плохости", который балансирует систему, а система уже достаточно хороша, чтобы давать прибыль. Попытавшись же сделать элемент начертания механическим, т.е. строго по алгоритму, т.е. якобы желая достичь совершенства, мы тем самым испортим всю картину.

Кстати, если подходить философски, скорее всего, именно по этой причине ни одна механическая система не сможет работать достаточно долго. Ее хватит на некоторое время, пока еще запас "плохости" не исчерпается, а затем она начнет давать все больше и больше сбоев. И снова понадобится человек, чтобы эту систему немного "попортить".

Таким образом, мы приходим к выводу, что на рынке можно работать, имея достаточный запас "плохости". Это хорошо укладывается в концепцию Сороса, что на рынке все действуют, используя ошибочные убеждения. И рынок никогда не достигает равновесия, потому что этого равновесия в принципе нет. Ожидания участников рынка постоянно искажают эту точку равновесия. Короче говоря, рынок стремится всегда в ту точку, которой он никогда не достигнет.

А в силу того, что механическая система должна подразумевать совершенство, то она могла бы работать только на "совершенном" рынке, а таковых нет. Вывод: создать механическую систему, долгое время приносящую прибыль, невозможно.

А человек достаточно "плох", в отличие от компьютера, чтобы вносить необходимую долю несовершенства, и таким образом, получать прибыль. Достигнув разумного баланса между совершенством компьютера и несовершенством человека, мы получаем стабильно работающую систему."

Очень интересное письмо, очень важные размышления и идеи, правда? Я благодарю Сергея от всех читателей за его интересное письмо.

КАПИТАЛ - 1. Стоимость, которая в результате использования наемного труда приносит прибавочную стоимость, т.е. самовозрастает.

2. Материальные ресурсы, предназначенные для создания еще больших материальных ресурсов (ценностей).

В.Ф, Корельский, Р.В. Гаврилов. Биржевой словарь.

Исходя из этого определения, депозит вполне можно считать капиталом. Но не следует забывать о том, что это - капитал, а не какие - то расходные средства. Иначе никакой долгосрочной успешной работы не получится.

Вот в июле этого года мой знакомый радостно сообщил, что открыл в Арго счет на 2000, и через неделю увеличил до 4000. Я сказал, - отлично, сними 2 тыс. и отложи на резервный счет, теперь, даже если ты проиграешь этот, есть резерв. И скапливай там капиталец, расти его. Тот сделал точно наоборот, снял три тысячи и купил машину. В ноябре он пришел и с унылым видом поведал, что оставшуюся тысячу на счете быстро проиграл, но, помня прошлые успехи, занял 10000, обещая вернуть с большими процентами, проиграл и эти деньги, продал машину - проиграл и эти деньги, не дам ли я ему денег, а то его убьют? Убить не убьют, но помучат, поэтому денег то я дал, но вместе с обещанием вернуть долги и выходить на рынок только с деньгами, предназначенными для инвестирования, то есть с капиталом, а не с деньгами, потеря которых ведет к катастрофическим последствиям (голод, потеря квартиры и пр.).

Почему я подробно об этом рассказываю? Во - первых, типичная ситуация, та самая яма, в которую не советую попадать. Во - вторых, вот это, по моему мнению, и есть управление капиталом, то есть стратегия управления всеми материальными ценностями, всем капиталом (а структура его, как правило, неоднородна), минимизирующая неизбежные риски и максимизирующая прибавочную стоимость. Эта проблема не нашла еще детального освещения, с другой стороны все имеющиеся книги о бизнесе только ею (проблемой управления капиталом) и занимаются. И я не буду подробно об этом останавливаться, тем более, различных сторон этой проблемы уже не раз касался. Просто представьте, что Ваш депозит - Ваше предприятие, магазин, например. Очевидно, что нужно его развивать, расширять ассортимент, значит - часть денег отчислять в фонд развития (просто оставлять часть прибыли на депозите), часть прибыли отчислять в страховой фонд (снимать периодически и аккумулировать на отдельном неприкосновенном счете), часть - в фонд развития - для развития существующего магазина и на создание новых (часть денег накапливать и открывать счета у других брокеров и на других рынках). И только в последнюю очередь часть денег снимается на зарплату, различные непроизводственные траты. То есть капитал растет, пока его растят, вот и весь секрет. (Когда у меня спрашивают, какая у меня зарплата, я не могу ответить. У меня ее просто нет. И если рост капитала требует, я затяну ремень потуже, но "щипать" капитал не буду). Маленькое уточнение - не поймите только, что нельзя снимать часть прибыли с депозита, я этого не говорил. Наоборот, необходимо регулярно снимать, кто этого не делает, подвергает постоянному риску все заработанное нелегким трудом. Весь вопрос, куда девать эту часть прибыли, впрочем - об этом я уже рассказал.

Вместо этого я встречал две основные модели поведения: первая - достать (даже путем заема!) 2 - 3 тысячи, за полгода сделать миллион, потом всю жизнь жить на Канарах. Упрощаю, конечно, но суть именно такова. Вторая модель - положить 1 - 2 тыс., "делать" 50 - 100 пунктов в месяц, и жить на эти деньги. К сожалению обе эти модели не приводят к процветанию. В бизнесе приходится, как выразилась Алиса в стране чудес, "бежать изо всех сил, чтобы хотя бы оставаться на месте". И пожалуйста, не занимайте денег, не пытайтесь набрать инвесторов, пока сами не сможете назвать себя профессионалом, пока не будет в распоряжении суммы, покрывающей долги в случае неудачи на рынке. В противном случае это приводит к крайне тяжелым последствиям.

Здесь приведу описание простой тактики от Райана Джонса.

ПРОСТОЙ МЕТОД ТОРГОВЛИ

Я слишком много говорил об эффективных и неэффективных методах с точки зрения простой логики рыночного процесса. Следующий метод, возможно, самый простой и логичный. Помимо этого, немногие системы или методы дают результаты, которые вы увидите на следующих нескольких страницах.
Этот метод построен на трендах и на коррекции. Здесь нет никаких других правил выхода, кроме выхода при ситуации реверсивного хода и использования защитной остановки. Если позиция по какому-либо инструменту является длинной, то она будет оставаться длинной до того момента, пока не появится сигнал о развороте и создании короткой позиции, либо об инициализации остановки, чтобы предотвратить потери. Результаты для восьми рынков приведены ниже.

 Метод, который дает эти цифры, удивительно прост. Правила таковы:

Покупка:

Среднее по закрытию, рассчитанное по "X"- дневному периоду, должно быть выше, чем аналогичное среднее "Y" дней тому назад.

Цена при закрытии должна быть меньше, чем аналогичная цена "Y" дней тому назад.

Цена при закрытии должна быть выше, чем цена на закрытие "Y+X" дней тому назад.

Если соблюдены все три условия, то нужно осуществлять покупку при открытии на следующий день.

Продажа:

Среднее по закрытию, рассчитанное по "X"- дневному периоду должно быть меньше, чем аналогичное среднее "Y" дней тому назад.

Цена при закрытии должна быть больше, чем аналогичная цена "У дней тому назад.

Цена при закрытии должна быть меньше, чем цена на закрытие "Y+X" дней тому назад.

Если соблюдены все три условия, то нужно осуществлять продажу при открытии на следующий день.

Например, если "Х"= 20 и "Y"=3, то 20-дневное среднее по закрытию должно быть больше (для покупки), чем это среднее, рассчитанное 3 дня тому назад. Это просто означает, что 20-дневное среднее по закрытию поднимается.

Затем необходимо, чтобы сегодняшняя цена при закрытии была ниже, чем цена при закрытии 3 дня тому назад. Это помогает определить, не произойдет ли откат ранее входа в рынок. В конечном итоге необходимо, чтобы цена (даже если она ниже, чем 3 дня назад) была также выше, чем 23 дня назад. Это проверка наличия восходящего скользящего среднего. Метод может действовать до тех пор, пока не возникнет сигнал разворота или если рынок не зайдет слишком далеко против позиции без сигнала о развороте.

Вот и все. Три очень простых, очень логичных правила дали тестовые результаты, приведенные выше. Показатели настолько внушительны, что не требуется проводить слишком глубокий анализ, чтобы понять, стоит ли им пользоваться или нет. Единственный вопрос - это каковы "X" и "Y"? Для всех практических целей "X" может быть любой величиной, которая отражала бы восходящее движение долгосрочного тренда. "У может быть любым числом, которое отражает краткосрочный откат. Некоторые значения "X" и "Y" дадут более обнадеживающие показатели по сравнению с другими значениями. Но, как правило, если цифры попадают под логику метода, они должны давать устойчивую статистику.

Я привожу не все таблицы, только с валютными фьючерсами. Кстати, интересный момент - по EUR прибыль минимальна. Так как остальные параметры примерно такие же, думаю здесь просто торговля велась раз в

5 меньшими объемами. Примеч. Б.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | CHF | JPY | EUR |
| Чистая прибыль | $81.800 | $118.300 | $13.250 |
| Выигрыш/проигрыш | 37/66 | 20/35 | 27/47 |
| % выигрышей | 56% | 57% | 57% |
| Средний выигрыш | $3,440 | $3.900 | $775 |
| Средний убыток | $1.570 | $1.500 | $384 |
| К-т выигр./проигр. | 2,19 | 2,60 | 2,02 |
| Средняя торговля | $1.239 | $2.235 | $280 |
| Макс. потеря капитала | -$9.000 | -$9.400 | -$2.850 |
| Средний выигрыш | $3,440 | $3.900 | $775 |

По моему, комментарии излишни. Остается подобрать устраивающие Вас значения X Y, протестировать это на истории и на демо счете - и вперед!

**И опять скользящие каналы.**

Многих не удовлетворила работа по СК в ноябре месяце. Это и не мудрено. Убытка особого почти никто не получил, но и пользы маловато. Это, отчасти, объясняется состоянием рынка - затяжным флэтом с попытками пробития 1.2000 вверх (кстати, пока пишу - свершилось. Однако следующая неделя покажет, действительно ли это прорыв, и увидим ли мы к концу года евро на 1.2500, или просто спекулятивный выброс, тогда опять пойдет неровная коррекция вниз).

Разумеется возникает сильное желание "подкорректировать", усовершенствовать тактику. Вот Дмитрий поделился c нами своими идеями на этот счет:

В прошлом своем письме я уже обращал внимание на проблему разворотов - мне тогда показалось, что трудновыполнима философия достижения минимальной цели, т.к. очень часто поджатие в 20п. на минимальной цели приводит-таки к срабатыванию этого трейлинг-стопа на минимальной цели, хотя бывают и исключения во время сильных движений и тогда мы ловим движение (а кто сказал, что торговать легко?). А тут еще мне попался на глаза метод Мартингейла и голову посетила мысль, а что если развороты делать с целью 20п и стопом 40, но двойным лотом, тогда, как я наивно полагал, мы почти гарантированно будем получать профит после разворота, компенсирующий предыдущие убытки. Эта мысль привела к довольно-таки серьезному исследованию разворотов. Вот на это уже прошу обратить внимание, этот важный элемент торговой стратегии является самостоятельным, как оказалось, фрагментом и он был проанализирован на указанном выше промежутке времени. База данных составила 79 разворотов: немного для настоящей статистики, но и немало, чтобы получить данные для общих выводов.

Так вот, что у меня получилось из этих 79 разворотов:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | одиночный, цель 40п. | двойной, цель 20п. | двойной, цель 30п. | двойной,цель 40п. |
| Stop Loss | 30 | 40 | 30 | 40 | 30 | 40 | 30 | 40 |
| Прибыльных сделок | 36 | 40 | 48 | 54 | 42 | 46 | 36 | 40 |
| Убыточных сделок | 43 | 39 | 31 | 27 | 37 | 33 | 43 | 39 |
| Результат, пункты | 150 | 40 | 40 | 0 | 300 | 120 | 300 | 80 |

Картинка получилась просто удивительной. Оказывается делать развороты в таком виде, как мы приняли "заднее не бывает", просто бессмысленно. Получился паритет по прибыльным и убыточным сделкам. Мы потеряем время и деньги на комиссионных и еже с ними. Мне было грустно, я очень загорелся мыслью торговать, как Вы предложили, тем более, что на данный момент времени это пока единственное, что мне известно, что четко алгоритмизировано и устойчиво прибыльно

Но как же так, ведь развороты изначально задуманы для того, чтобы входить в сильные движения, выбившиеся из рамок начерченных нами каналов на величину стопа, и приносить прибыль?
Что я понял, когда начал этот анализ разворотов? Приблизительно в половине случаев, как показала статистика разворотов, мы ловим "лосей" в результате того, что наша формализация определения пиков дала нам в данный момент времени более узкий канал, чем присутствует на самом деле (тут поможет опыт, но это уже отдельная тема и к МТС, как набору правил, не относится), либо, когда тенденции движения сохраняются, но канал деформируется более существенно, чем может вместить наш стоп. В обоих случаях мы получаем практически неминуемый второй лосс. А вот, если движение действительно перевернулось, то цена проходит не 30п, и не 60, а больше. А насколько больше, спросил я, пробежавшись по прибыльным разворотам с линейкой, при условии, что мы отпустили цену с поджатием 50п. При прохождении 40п - паритет. 60п - поджимаемся на +10, чтобы было 50 трейлинг стопа. И вот что получилось.

Развороты от стоплосса в 40п.(общее количество - 79)

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Цель, п. | стоп 40п. - 39лоссов (-1560п.) | стоп 30п. - 43 лосса (-1290п.) |
| кол-во | прибыль | депозит | кол-во  | прибыль | депозит |
| 40 | 40 | 1600 | 40 | 36 | 1440 | 150 |
| 50 | 34 | 1700 | 140 | 31 | 1550 | 260 |
| 60 | 30 | 1800 | 240 | 27 | 1620 | 330 |
| 70 | 28 | 1980 | 420 | 25 | 1770 | 480  |
| 80 | 23 | 1960 | 400 | 21 | 1780 | 490  |
| 90 | 18 | 1890 | 330 | 16 | 1690 | 400  |
| 100 | 16 | 1950 | 390 | 14 | 1730 | 440  |
| 110 | 15 | 2050 | 490 | 14 | 1810 | 520  |
| 120 | 15 | 2200 | 640 | 13 | 1940 | 650  |
| 130 | 12 | 2170 | 610 | 10 | 1890 | 600 |
| 140 | 8 | 2050 | 490 | 7 | 1810 | 520 |
| 150 | 6 | 2010 | 450 | 5 | 1760 | 470  |

У меня получилось, что если T/P устанавливать в районе 120-130п, то результаты достойны надежд. Чуть хуже, но тоже взрывом выстреливает вверх величина профита 70-80п, тут уже за счет количества положительных исходов. И еще, лучшие результаты получаются при стопе в 30п. Должен сказать, что если разворот делать от величины 35п., а не 40, то таблица достижений окажется еще в более выигрышной ситуации (на +5п.). И вот здесь мне кажется, можно существенно повысить эффективность разворотов за счет удвоения позиции на развороте.

Получилась такая картинка. Если разворачиваться двойным лотом со стопом 30п. то при цели 70-80п. мы получим к нашему балансу 3766 дополнительно 900п. (недурно, не правда ли?). При этом двойной лосс будет выглядеть менее привлекательно (что вполне естественно), 95п. против 70 или 80 (для 35 или 40п исходного варианта),но не намного. Это ухудшит ситуацию в плохие месяцы, а у меня при тестировании было три двойных лосса подряд (я не отдыхал два дня во время тестирования, а гонял все подряд). Кстати, заодно и проверим... Проверил... У меня после двойного лосса убыточная сделка встретилась 13 раз, а прибыльная - 22. Разница уже немаленькая, чтобы делать выводы. Неопытному глазу, как мой, кажется, что для депозита двухдневный отдых после двойного стопа - вещь не очень нужная, а нужная она, скорее, для психики.

Вот всем пища для ума и простор для тестирования. Я немного подытожу, в чем основные идеи Дмитрия:

Применять после разворота удвоение позиции, то есть если, например, была покупка одним лотом, надо продавать три (один - закрытие, 2 - новая позиция). Здесь, я добавлю, интересно, что дальше делать? Удваивая позицию, мы, с одной стороны, подвергаем депозит удвоенному риску. Значит второй стоп следует подвигать уже вдвое ближе? Далее, получили убыток при развороте, скажем, 57 пунктов. Значит можно после разворота, при проходе 57 пунктов в плюс, закрыть половину, а вторую "отпустить", вдруг большой приз попадется? Это очень оправдано психологически- когда, взяв убыток, видишь, что Equty восстановилась, очень хочется закрыться. Это часто основная причина преждевременного закрытия. Или продолжать удвоенными темпами грести профит? В общем - поле для исследований

Не спешить закрывать профит, а дать ему вырасти, как минимум до 120 - 130 пунктов. Это значит- не спешить поджимать на 50 пунктах, а "дать свободу" со стопом в 90 - 100 пунктов, может и больше, и плотнее "прижать" когда профит достаточно велик.

Все это требует длительных проверок.

Какие еще пути совершенствования? Здесь очень важно не скатиться к банальной подгонке, когда за ноябрь получим хорошие результаты, а в понедельник начнется длительный поход вверх, и наша тактика опять начнет нас "крутить".
О том, что последние месяцы оказались не очень эффективными, я уже говорил выше. При этом "бросалось в глаза" то, что все открытия от границ канала заканчивались разворотом со взятием прибыли, и только потом образовывалась прибыль. Вспоминается старый анекдот про метеоцентр, вероятность прогнозов которого была 0.4. Стали давать прогнозы "наоборот" - получили вероятность 0.6! Может и в данном случае следует также поступить? То есть на границе канала работать не внутрь канала, а в наружу, на пробой волатильности?

В результате образовалась такая схема (до шаблона, полноценной тактики еще требуется масса исследований и доработок): Делим канал на три зоны (в ArtStok просто чертим не параллельную, а линию с уровнями Фибоначчи). Если цена в верхней зоне - продаем, в нижней - покупаем, в середине - ждем. При покупке стоп с разворотом - точка ниже нижней линии на расстоянии спрэд + 5/10 пунктов, соответственно при продаже - точка выше верхней линии канала на том же расстоянии.

При профите можно попробовать поджатие базовой технологии, но можно и так: ставим тейк на противоположную границу, в точке выше (ниже), там где ставится стоповый ордер, опять открываем позицию, покупку, при прохождении верхней точки (граница канала + спрэд +5(10) пунктов), аналогично внизу. То есть мы фиксируем прибыль, если движение продолжается и пробивается канал - продолжаем играть в ту же сторону, отдав 10 - 15 пунктов рынку. При этом стоп ставиться с разворотом под линией на том же расстоянии.