



АЛГОРИТМ

*для intraday-торговли акциями
на New York Stock Exchange (NYSE)*

by Anton Fiodorov



Содержание_

Распорядок дня.....	4
Домашка.....	5
Графики.....	10
Подготовка рабочего места. Настройка на работу.....	24
Торговля.....	25
-общие положения.....	25
-правила входа.....	26
-сопровождение позиции.....	27
-добавление к позиции.....	27
-правила выхода.....	28
Риск-Менеджмент.....	30
Дневник сделок. Психологический дневник.....	33
Еженедельный разбор всех сделок/ Разбор серии убытков.....	36
Релакс. Психологические тренинги.....	37

Ты должен понимать, что
ТОЛЬКО 100% СОБЛЮДЕНИЕ АЛГОРИТМА
дает тебе возможность выжить в этом бизнесе.
В противном случае,
рассчитывать тебе особо не на что.



Открывая сделку – помни об этом!!!!

Распорядок Дня

- 01:00 - 03:00 – Домашка. (первая часть)
- 12:00 - 14:00 – Домашка. (вторая часть)
- 14:00 - 14:45 – Разметка уровней. Ознакомление с новостным фоном.
Анализ фьючерсов
- 14:45 - 15:00 – Смотрю дневник сделок.
- 15:00 - 15:30 – Обед.
- 15:30 - 15:45 – Не сижу за компьютером. Гуляю, слушаю музыку, медитирую, настраиваюсь морально на рабочий день.
- 15:45 - 16:00 – Подготовка рабочего места.
- 16:05 - 16:30 – Брифинг.
16:30 – Начало торговой сессии.
- 16:30 - 17:00 – Ищу паттерн «Сила Утра».
- 17:00 - 19:00 – Ищу базы. Ищу сетапы на отбой от уровней по тренду.
- 19:00 - 20:00 – Ужин.
- 20:00 - 23:00 – Ищу базы.
- 23:00 - 23:30 – Душ. Релакс.
- 23:30 - 01:00 – Записи в дневник сделок и психологический дневник.
- 01:00 - 03:00 – Первая часть домашки на следующий день.

Stock selection «Домашка»

Подготовку к следующему рабочему дню начинаю с вечера, после закрытия рынков в Америке.

«Домашку» делю на два этапа: от **“А”** до **“К”** (первая часть), и от **“К”** до **“Z”** (вторая часть) с целью сохранения адекватности восприятия рыночной информации на протяжении всей домашней работы.

Первый этап делаю вечером после закрытия, второй – утром.

Первая часть – 01:00-03:00

Вторая часть – 12:00-14:00

Цель отбора акций найти бумаги, которые:

- » Живут своей жизнью (не ходят за Индексом)
- » В которых есть четкий, ярко выраженный тренд
- » В которых есть выход объёма (следы крупного покупателя /продавца)
- » В которых есть потенциал хода (запас до ближайшего уровня поддержки/сопротивления)

Для общей «домашней работы» отбираю акции по следующим параметрам:

1. Общий перебор большого количества акций

Filters: 5				Descriptive(5)	Fundamental	Technical	All(5)		
Exchange	NYSE	Index	Any	Sector	Any	Industry	- Stocks only (e)	Country	USA
Market Cap.	Any	Dividend Yield	Any	Float Short	Any	Analyst Recom.	Any	Option/Short	Any
Earnings Date	Any	Average Volume	Over 500K	Relative Volume	Any	Current Volume	Any	Price	Over \$10
<div>Reset (5)</div>									

2. Акции, которые вышли вчера на самую высокую точку за последние 20 дней

Filters: 7		Descriptive(5)			Fundamental		Technical(2)		All(7)	
Exchange	NYSE	Index	Any	Sector	Any	Industry	- Stocks only (e)	Country	USA	
Market Cap.	Any	P/E	Any	Forward P/E	Any	PEG	Any	P/S	Any	
P/B	Any	Price/Cash	Any	Price/Free Cash Flow	Any	EPS growth this year	Any	EPS growth next year	Any	
EPS growth past 5 years	Any	EPS growth next 5 years	Any	Sales growth past 5 years	Any	EPS growth qtr over qtr	Any	Sales growth qtr over qtr	Any	
Dividend Yield	Any	Return on Assets	Any	Return on Equity	Any	Return on Investment	Any	Current Ratio	Any	
Quick Ratio	Any	LT Debt/Equity	Any	Debt/Equity	Any	Gross Margin	Any	Operating Margin	Any	
Net Profit Margin	Any	Payout Ratio	Any	Insider Ownership	Any	Insider Transactions	Any	Institutional Ownership	Any	
Institutional Transactions	Any	Float Short	Any	Analyst Recom.	Any	Option/Short	Any	Earnings Date	Any	
Performance	Any	Performance 2	Any	Volatility	Any	RSI (14)	Any	Gap	Any	
20-Day Simple Moving Average	Any	50-Day Simple Moving Average	Any	200-Day Simple Moving Average	Any	Change	Any	Change from Open	Any	
20-Day High/Low	New High	50-Day High/Low	Any	52-Week High/Low	Any	Pattern	Any	Candlestick	Any	
Beta	Any	Average True Range	Over 0.5	Average Volume	Over 500K	Relative Volume	Any	Current Volume	Any	
Price	Over \$10									Reset (7)

3. Акции, которые вышли вчера на самую низкую точку за последние 20 дней

Filters: 7		Descriptive(5)			Fundamental		Technical(2)		All(7)	
Exchange	NYSE	Index	Any	Sector	Any	Industry	- Stocks only (e)	Country	USA	
Market Cap.	Any	P/E	Any	Forward P/E	Any	PEG	Any	P/S	Any	
P/B	Any	Price/Cash	Any	Price/Free Cash Flow	Any	EPS growth this year	Any	EPS growth next year	Any	
EPS growth past 5 years	Any	EPS growth next 5 years	Any	Sales growth past 5 years	Any	EPS growth qtr over qtr	Any	Sales growth qtr over qtr	Any	
Dividend Yield	Any	Return on Assets	Any	Return on Equity	Any	Return on Investment	Any	Current Ratio	Any	
Quick Ratio	Any	LT Debt/Equity	Any	Debt/Equity	Any	Gross Margin	Any	Operating Margin	Any	
Net Profit Margin	Any	Payout Ratio	Any	Insider Ownership	Any	Insider Transactions	Any	Institutional Ownership	Any	
Institutional Transactions	Any	Float Short	Any	Analyst Recom.	Any	Option/Short	Any	Earnings Date	Any	
Performance	Any	Performance 2	Any	Volatility	Any	RSI (14)	Any	Gap	Any	
20-Day Simple Moving Average	Any	50-Day Simple Moving Average	Any	200-Day Simple Moving Average	Any	Change	Any	Change from Open	Any	
20-Day High/Low	New Low	50-Day High/Low	Any	52-Week High/Low	Any	Pattern	Any	Candlestick	Any	
Beta	Any	Average True Range	Over 0.5	Average Volume	Over 500K	Relative Volume	Any	Current Volume	Any	
Price	Over \$10									Reset (7)

(Если хочу сузить спектр отбора акций, дополнительно во вкладке “All” указываю параметры: New High, New Low, 20-Day High/Low, Top Gainers, Top Losers, Unusual Volume, Earnings, 52-Week High/Low).

Перебор акций осуществляю по дневному и пятиминутному графику. В результате перебора должно быть сформировано два списка – «Приоритетный» и «Дополнительный»

Для того чтобы акция попала на Приоритетный лист, она должна полностью соответствовать правилам для дневного и пятиминутного графика:

«ПЯТЬ ПРАВИЛ» соответствия дневного графика

- » Имеет не рваный, плавный график (без множества «гэповых» дней)
- » Имеет понятный тренд и живет своей жизнью (не ходит за родительским Индексом)
- » Имеет существенное повышение объема последние 1-2 дня. (по сравнению с пред. днями)
- » Имеет потенциал для движения (запас хода)
- » Имеет нормальный объем: **over: 500k**, и **ATR: over 0.5**

«ПЯТЬ ПРАВИЛ» соответствия пятиминутного графика

- » Плавная пятиминутка
- » У акции хороший внутридневной ход
- » Акция на истории чисто отрабатывает мои формации
- » Акция формирует и хорошо держит уровни внутри дня и даёт поставить короткий стоп
- » В прошлые дни акция демонстрировала понятные движения. (я понимаю как она торгуется)

Если в акции хорошая дневка, которая подходит по всем параметрам, но пятиминутка не соответствует (*например: нет баз и зон консолидации для входа*), то такую бумагу заносу в Дополнительный лист. Буду перебирать его в течении дня и ждать пока появятся мои сетапы.

У всех бумаг, обращаю внимание на положение мувингов (SMA 200, 50, 20) относительно текущей цены. Эти скользящие могут играть роль важных уровней поддержки\сопротивления на дневном графике.

Подходящие мне акции записываю в ведомость и делаю комментарии. Записываю цены уровней, признаки по которым я отобрал эту бумагу на основной лист (*объем, range, исторически значимый уровень, New High/Low*), какой у компании Гайденс и Сюрпрайз (*если есть отчет*). Это позволяет не держать в голове данные по двум десяткам бумаг о причине попадания их на лист.

Пример:

Тикер	Комментарии
NUS	Хуже рынка. Растянутый бар на объеме. Пробит важный уровень - 40\$. Ждать на пятиминутке базу на продолжение в шорт.

После попадания бумаги на лист, наблюдаю ее в течении трех дней на предмет отработки потенциала по моим сетапам.

- 14:00-14:30 По окончании перебора вбиваю эти списки в WatchList'ы и наношу на пятиминутный график уровни, от которых я буду искать точки для открытия позиций
- 14:30-14:45 Смотрю новостной фон. Если фьючерс уже торгуется с большой разницей относительно цены закрытия прошлой сессии, вероятнее всего рынок откроется с Гэпом в эту сторону. Смотрю, какая новость привела к сильному колебанию фьючерса.
Смотрю, какие новости будут выходить в ходе грядущей сессии, чтобы знать в какие моменты стоит быть вне рынка или чтобы не удивляться если рынок резко начнет даунтировать на плохой новости.
- 14:45-15:00 Смотрю дневник сделок. Пересматриваю сетапы из алгоритма. Читаю недельное резюме по сделкам.



Графики {Дневной график}

Пробой исторически значимого уровня на объеме.



Последние 10 дней бумага жила своей жизнью и не ходила за индексом. Нашла сопротивление в районе **45\$** и от него начала снижаться. После пробоя уровня **42,50\$** выходит объем и на следующий день бумага пробивает важный уровень - **40\$** растянутой свечей на объеме и закрывается значительно ниже этого уровня в Low.

Растянутая свеча+объем+пробитие уровня – акция однозначно попадает на лист и наблюдается три дня на наличие моих сеталов на пятиминутке.

Выход на New High на растущем объеме



Бумага находится в ап-тренде и хорошо держит уровни на дневке. Предыдущий день закрывается вблизи уровня сопротивления – **50\$**, а следующий день открывается с Gap UP и после быстрого теста **50\$** сверху, улетает на объеме вверх.

День закрывается в High растянутой свечей на объеме. Бумага вышла на All Time High. Акция попадает на лист и три дня наблюдается на наличие сетпапов на пятиминутке. Потенциал бумаги неограничен.

Выход на New Low на растущем объеме



Бумага намного хуже рынка. Сливают после отчета. Последние три дня бумага падала на повышающихся объемах. Последний день закрывается в Low на повышающемся объеме. Акция вышла на самую низкую точку за несколько лет. Можно искать в бумаге точки на продолжение движения в шорт по сетапам на пятиминутке.

Выход из консолидации на объеме.



Бумага живет своей жизнью. В течении 9 дней бумага консолидировалась в районе **10\$**. Последние 2 дня консолидации в акции повысился объем по сравнению с остальными днями, что говорит мне о том, что в акции усиливается интерес «умных денег». На 10й день бумага выходит из консолидации, но объем не повышается.

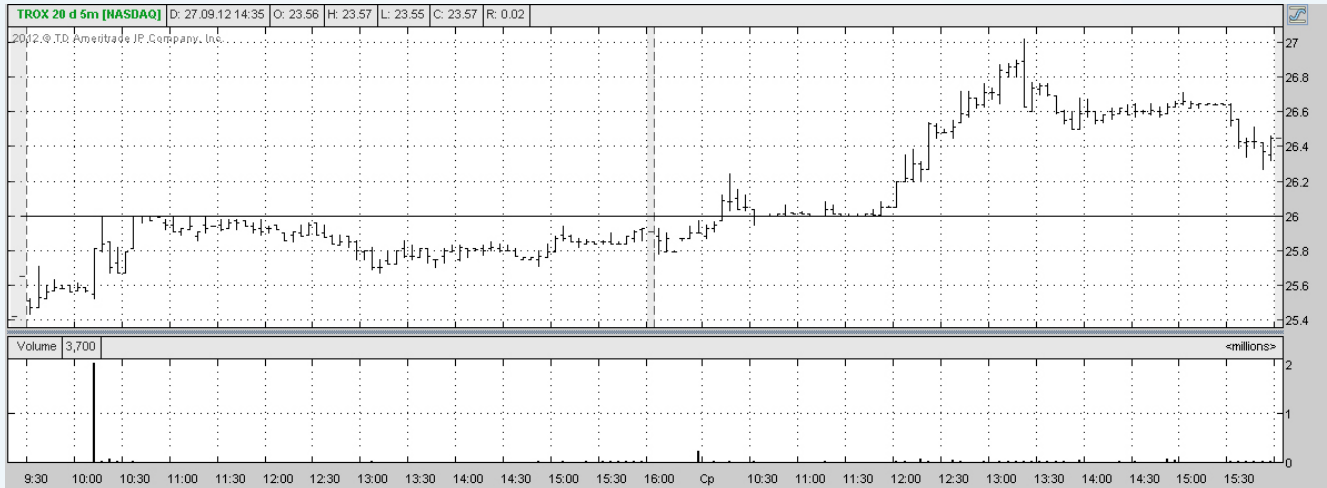
Акция попадает на лист только на 11й день после растянутой свечи на очень высоком объеме с закрытием под хай. Потенциал хода в акции: 50центов (до 12\$)



Графики {Пятиминутный график}



Зеркальный уровень. Сопротивление становится поддержкой.

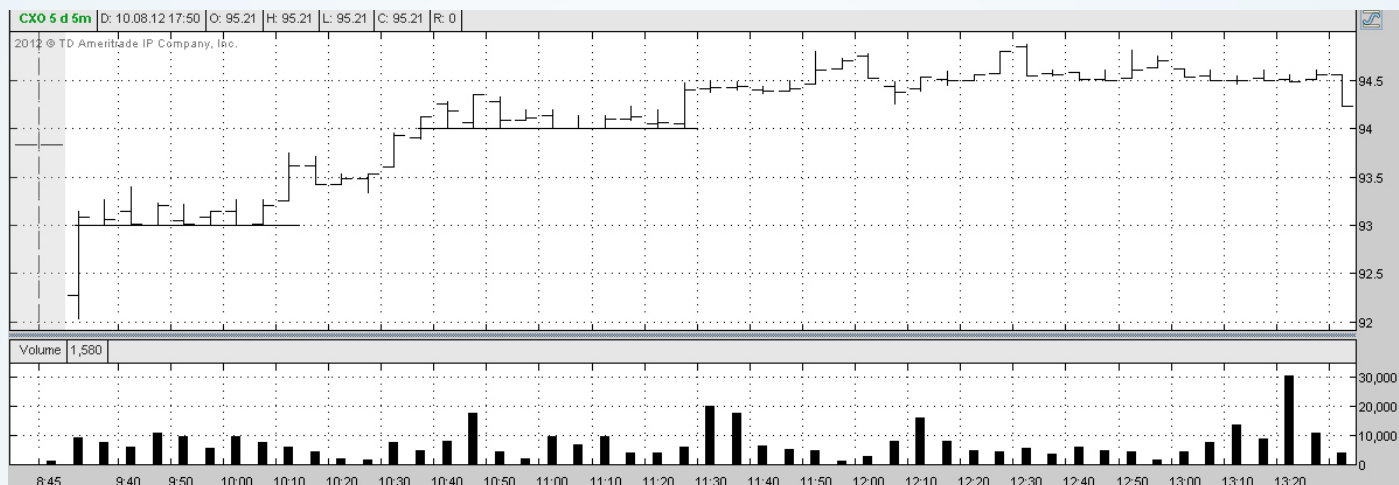


Акция в ап-тренде. В предыдущий день акция находит уровень сопротивления по **26\$**, который не может пройти. На следующий день сутра пробивает сопротивление и становится сверху в консолидацию. Появляется лимитный покупатель, который держит цену **26\$**. В акции есть объем, можно набирать позицию согласно риск-менеджменту.

Захожу в лонг Limit-ордером на 4м баре проторгованном сверху уровня.



«Сила утра» =)

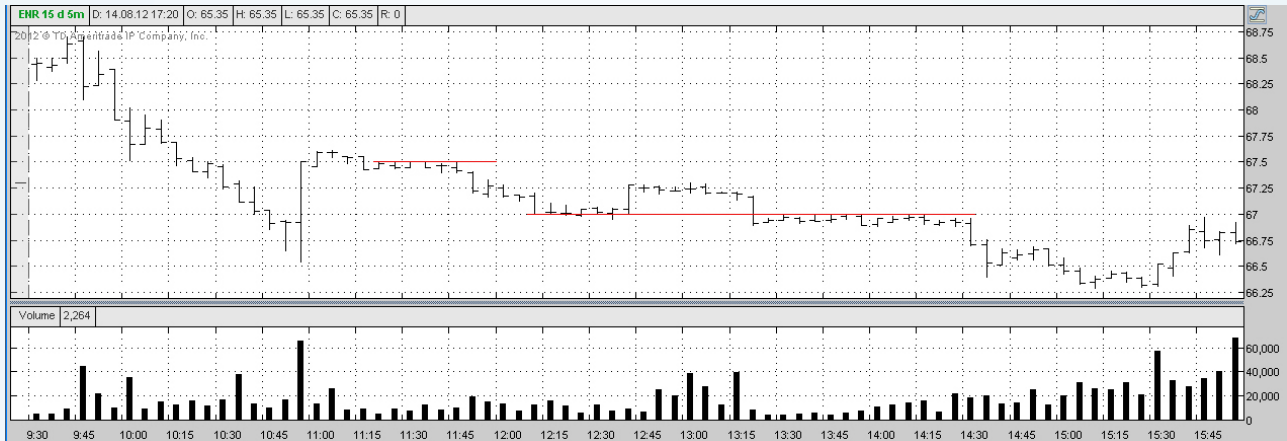


Акция в ап-тренде. Открывается с импульсом, но в первые пол часа в ней появляется сильный статичный бид по цене **93\$**. *В этот момент акция начинает жить своей жизнью и никак не реагирует на внутридневные движения индекса.* Формируется четкий уровень поддержки, за который можно поставить короткий и понятный стоп.

Вход осуществляю на 4м баре Limit-ордером по самой лучшей цене 93\$. По **94\$** ситуация повторяется. Те же правила, тот же риск.



Уровень по тренду после откупа шортов. (поддержка становится сопротивлением)

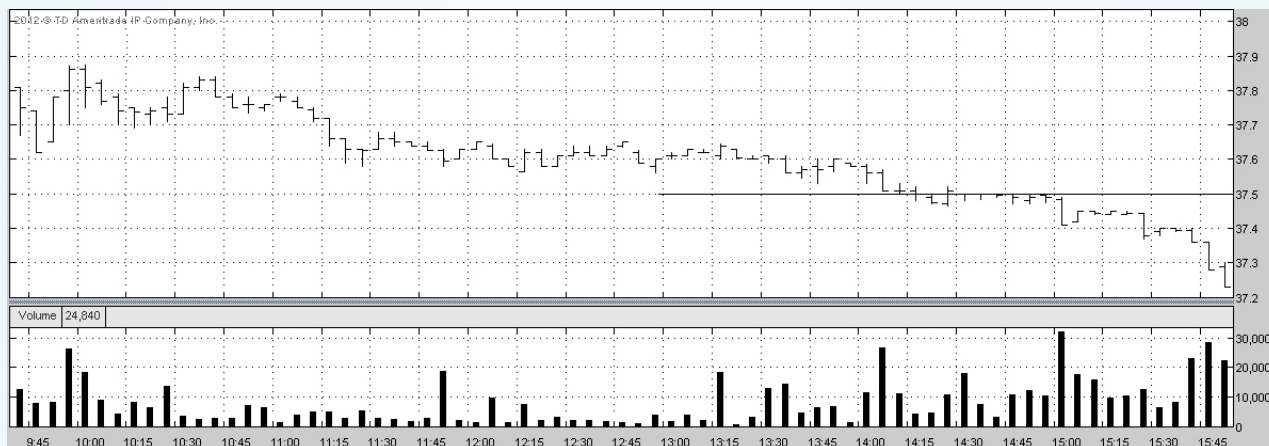


Эмитент находится в даун-тренде. Происходит частичная фиксация прибыли с выходом объема, и акция начинает расти. Пробивает уровень **67,50\$**, но не может за ним закрепиться и сваливается под него. В акции появляется лимитный продавец, который останавливает рост и начинает держать уровень цент в цент. После откупа шортов – это сильный сигнал присутствия в бумаге продавца.

По **67\$** поддержка становится сопротивлением. Можно добавляться или повторно заходить в шорт. В обоих случаях стоп абсолютно понятен и очень короткий.



База на продолжение тренда после отката. (Степающий офер.)

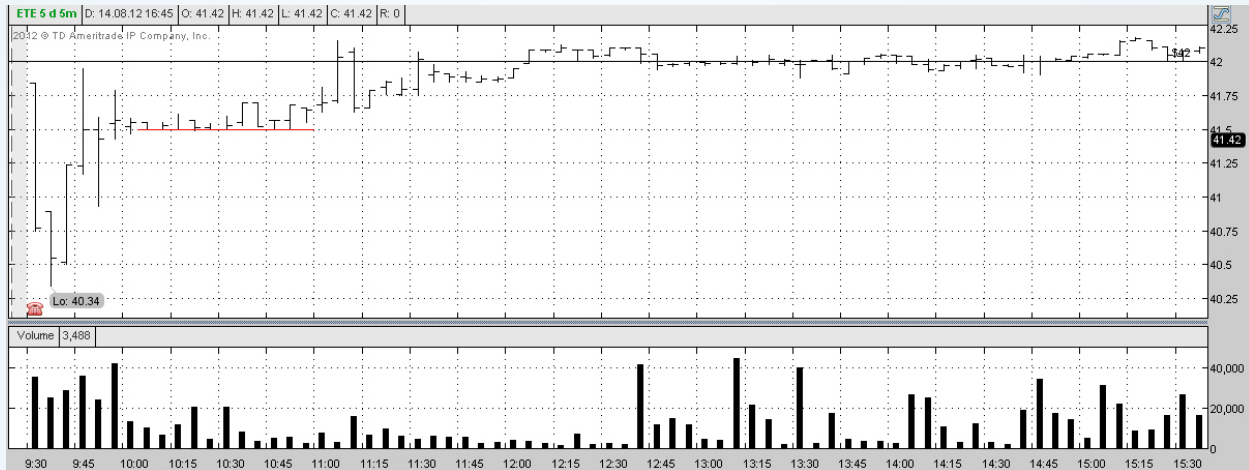


Акция в даун-тренде. Открывается вверх, но в течение утренней сессии выходит объем и бумага находит уровень сопротивления. Начинает развиваться движение в сторону основного тренда. Сигнал появляется только во второй половине дня, когда бумага находит статичный офер по цене **37,50\$**. Формируется четкий уровень сопротивления, за который можно поставить стоп. По ходу движения цены, лимитный продавец идет за рынком и смещает свои заявки на уровень **37,45\$** и **37,40\$**.

На этих уровнях можно добавляться к позиции если позволяет риск-менеджмент. Вход стандартный: Limit-ордером на 4м баре по самой лучшей цене.



Уровень после разворота

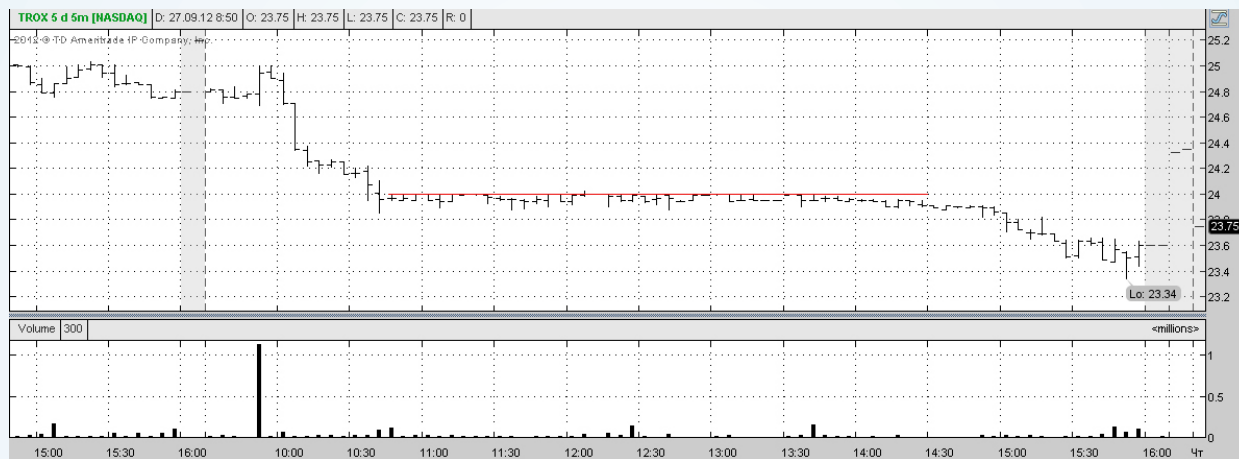


Отчетная бумага. С открытия падает на объеме. Но принцип причины и следствия не выполняется. На падении бумага встречает покупателя и третьим баром ее разворачивают и возвращают в район точки открытия. Акция успокаивается и находит уровень поддержки по **41,50\$**. Покупатель держит level цент в цент, что позволяет поставить короткий и понятный стоп.

Вход на Limit-ордером на 4м баре держащем 41,50\$.



Длинная база.



Бумага находится в даун-тренде. В начале сессии идет вверх, но на одном пятиминутном баре выходит огромный объем, после чего акция резко разворачивается. Бумага пробивает **24\$** и находит уровень сопротивления.

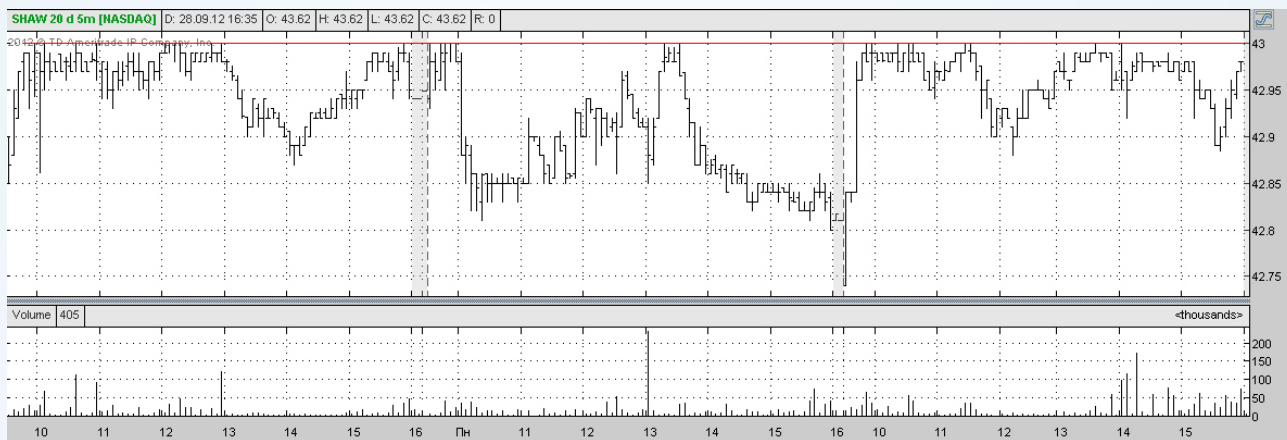
Вход на 4м баре Limit-ордером по самой лучшей цене.

В такой бумаге нужно сидеть пока либо:

- 1) не выбьет по стопу*
- 2) отработается сигнал*



Отбой от ценовой фигуры в течении нескольких дней.

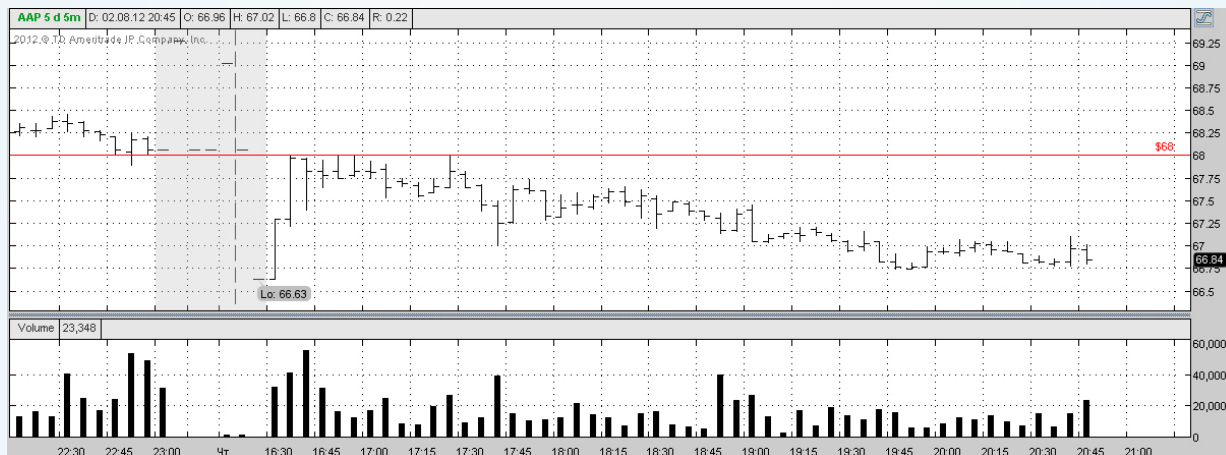


Происходит консолидация у значимого ценового уровня, от которого бумага откалывается несколько сессий подряд. Можно брать на отбой с небольшим потенциалом (*до 20 центов*) и коротким стопом (*1-2 цента*).

Вход Limit-ордером на 4м баре по самой лучшей цене.
В случае сквиза более одного раза не перезаходить потому что портится мат. ожидание от сделки.



Шорт от уровня после перекрытия гэпа (Гар через уровень поддержки)



Акция находится в даун-тренде и закрытие предыдущего дня происходит на важном уровне **68\$**. Бумага открывается с гэпом вниз и быстро возвращается к важной цене, но уже снизу. Железно держал цену **68\$**.

Вход на 4м баре Limit-ордером по цене уровня.

Подготовка рабочего места. Настройка на работу (15:45-16:00)

- » Включаю большой свет.
- » Навожу порядок на столе.
- » Открываю алгоритм на странице 16 (*Раздел «Сетапы пятиминутки».*)
- » Кладу на стол ведомость с домашки и чистый лист для дополнительных записей.
- » Перевожу телефон в беззвучный режим и убираю в стол.
- » Проверяю, работает ли резервный канал интернета.
- » На кухне обязательно ставлю тарелку с чистыми фруктами и графин с водой (*для перерыва в соответствии с риск-менеджментом*).

Торговля. Общие положения.(16:30-23:00)

- » Торгую только отбои!
- » Отбои от уровней, после отката бумаги со своего Day High беру с пониженным объемом - 100 акций
- » Раз в 15 минут перебираю полностью весь портфель (оба листа)
- » Во время работы, ни в какие трейдерские чаты и группы не захожу! Зашел – нарушил алгоритм!
- » Торгую акции ТОЛЬКО СО СВОЕЙ «домашней работы»!!!
- » Интернет использую только для сайтов finviz.com, streetinsider.com.
- » Никаких vkontakte, youtube и иже с ними. Зашел – нарушил алгоритм!
- » Никакой музыки!!! Шум кулера – твое музыкальное сопровождение!

Условия входа в позицию

- » Сигнал на отбой принимаю ТОЛЬКО ПО ТРЕНДУ на дневном графике
- » Захожу только Buy\Sell Limit-ордерами
- » Вход ВСЕГДА должен быть ОТ СТОПА
- » Стоп должен быть в пределах 2-4 центов на акцию
- » Потенциал в сделке должен быть минимум 1 к 3
- » Спрэд в акции должен быть 1-2 цента
- » В базе должно быть проторговано минимум 3 пятиминутных бара
- » Вход осуществляю на 4м баре
- » Limit-Ордер на вход ставлю по цене базы или на 1-2 цента раньше если в лучшую цену базы больше не печатают
- » Stop-Ордер отправляю сразу после того как отправил Limit.
- » Стоп ставлю 1-2 цента за уровнем базы или за сквиз, если он не превышает 3 цента
- » Если есть сквизы, они должны быть затянуты обратно в уровень. Риск в таком случае не увеличиваю, просто вход должен быть по самой лучшей цене базы, чтобы сохранялись условия по величине стопа.
- » В случае ложного пробоя, перезаход осуществляю на третьем пятиминутном баре после возвращения цены в уровень.
- » После первого стопа для перезаходов есть еще максимум ДВЕ попытки.
- » После 3х неудачных попыток паттерн считается «бракованным» и торговаться не должен!

Если упущена возможность для входа - рынок НЕ ДОГОНЯЮ!

НИКАКИХ MARKET-ОРДЕРОВ!!!

Лучше пропустить прибыльный трейд, чем войти по плохой цене и необоснованно увеличить риск по сделке.

Сопровождение позиции (на примере покупки)

Смотрю стакан и ленту. Bid должен быть плотным и больше чем Ask. Bid должны переставлять «стэпать» плотно за рынком – это признак присутствия покупателя.

Принты в большей степени должны проходить по цене Ask и в спрэде, реже по Bid. Если проходит много сделок в спрэде и по Ask'y – это значит, что Bid перекрывается – это хороший знак для дальнейшего удержания позиции.

После первого удачного отката передвигаю стоп под него. По ходу движения цены передвигаю стоп под локальные уровни консолидаций и откатов.

Добавление к позиции

Максимальный объем для добавления к позиции: *100 акций*.

Добавление разрешается только в случае, если первоначальный объем позиции был *300 акций*.

Если меньше – дальше можешь не читать!

Добавление к позиции происходит только от локальных уровней подтвержденных не только графически, но также принтами и стаканом. Должен быть проявлен лимитный покупатель, который будет держать одну и ту же цену, и сформирует локальный уровень поддержки, за который можно будет поставить стоп с минимальным риском (1-2 цента).

Выход из позиции

Выход стараюсь осуществлять Limit-ордерами на заранее определенных уровнях.

Первые 100 акций закрываю для положительной статистики.

Для позиции 200 акций:

Limit-ордер на выход первыми 100 акциями:

Target 1 = **Stop+Commission**

Limit-ордер на выход на вторыми 100 акциями (*основная цель*):

Target 2 = **(Stop+Commission)*3**,
or better = **(Stop+Commission)*5**

Пример:

Открываю позицию на 200 акций: *Buy Limit no* **43,00\$** - Vol.: 200.

Сразу отправляю два ордера:

1. *Защитный Sell-Stop no* **42,98\$** - Vol.: 200.

2. *Sell-Limit no* **43,10\$** - Vol.: 100.

Вторые 100 акций я оставляю по первоначальному стопу - т.е. **42,98\$**.

Закрывая первые 100 акций, я обеспечиваю небольшую прибыль по этой сделке нетом.

Таким образом, я:

1. Избавляюсь от любых волнений связанных с вероятностью получить убыток по сделке.
2. Могу свободно переключиться на перебор портфеля и поиск точек входа в другие позиции.



Вторыми 100 шерс я высиживаю позицию и закрываю их Limit-ордером по ходу цены на целевом уровне.

Целевым уровнем может быть ближайший уровень поддержки/сопротивления или исторически важный уровень, определенный по дневному графику на котором может быть скопление объема и от которого цена может развернуться.

Если такой уровень не был определен (*например, акция вышла на All Time High*), то стоит смотреть ленту:

1. Как только лента «замирает», Bid редет, а в Ask'e появляются большие лоты и принты начинают печатать больше в Bid, в спрэд и меньше в Ask, можно смело говорить о том, что как минимум назревает технический откат и стоит либо крыть часть позиции, либо закрываться полностью.

2. Если во время сопровождения позиции в акции начался выход объема (большие бары на высоком объеме), то лучше выходить из этой бумаги Limit-ордером по ходу движения цены на ближайшем локальном уровне поддержки/сопротивления.



Риск-Менеджмент

Риск-Менеджмент

- » Торгую только в спокойном, эмоционально стабильном состоянии.
- » **В стрессовые дни**, когда есть проблемы вне трейдинга **НЕ ТОРГую** **вообще!**
- » **Лимит потерь** на одну торговую сессию: **30 USD** без учета комиссии.
- » Максимальное количество шерс за сессию: **2000** акций
- » Стандартный объем в одной позиции: **200** акций
- » Максимальное количество сделок за одну сессию: **5**
- » Отдаю обратно в рынок **не больше 30%** от полученной прибыли.
если заработал **100\$** нетом, то могу потерять **не более 30\$**
(с учетом комиссии).
- » Допускается **3** убыточных сделки подряд. **После трех убытков – перерыв 30 минут.** Графики не смотрю, отхожу от компьютера. Ем фрукты, пью воду. *Делаю упражнения из раздела «Психологические тренировки».*
- » Если после перерыва совершается **еще 2 убыточных сделки – торговля на сегодня окончена.** Закрываю терминал, ухожу от компьютера. До 23:30 я не трейдер. *(Не нужно мотать себе нервы чтением чужих сделок из чата и просмотром графиков. У тебя своя статистика, свой депозит и своё здоровье)*
- » Допускается не больше трех убыточных дней подряд. **После трех дней убытков – 2 дня не торгую.** Первый день – отдыхаю от рынка. Второй анализирую убыточные сделки.

Размер автоклоуза 30 USD вовсе не значит, что ты должен топить до талого пока тебя не закроют в кабину, если ты сегодня не в ритме с рынком.

Настоящий риск-менеджмент это ТВОЙ САМОКОНТРОЛЬ.

Не будешь контролировать сам себя – никому ты по большому счету нахрен не нужен.

Если видишь, что твои **ожидания расходятся с рынком–ОСТАНОВИСЬ!**

Скорее всего, ты продолжишь терять и дальше, а если нет, то это будет лишь случай везения и он лишь усугубит твою уверенность в безнаказанности, которая приведет к еще большим потерям и психологическим расстройствам.

Объемы позиций

Чем выше риск, тем меньше объем.

Чем выше объем, тем короче стоп для сохранения низкого риска.

Стандартный заход от базы - макс. стоп: **3 цента**

объем: **200 акций**

Паттерны «Сила Утра» и «Зеркальный уровень» - макс. стоп: **2 цента**

объем: **300 акций**

При увеличенном риске, когда:

1) в самую лучшую цену не печатают или

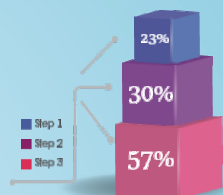
2) после отката бумаги со своего Day High

максимальный стоп: **4 цента** и объем **100 акций**

После 4 недель подряд закрытых в плюс нужно увеличить объемы по всем типам позиций на 100 акций.

Не думай! Просто соблюдай алгоритм!

Статистика
Дневник Сделок
Психологический дневник



Дневник сделок. Психологический дневник. (23:30-01:00)

Запись сделок в дневник начинаю делать после закрытия рынка в 23:30. Распечатываю скриншот пятиминутки и дневки. Вырезаю и клеиваю распечатку в дневник. Записываю дату, тиккер и в скобках была ли сделка прибыльной или убыточной.

Описываю идею:

- » Попала ли бумага на лист с домашки или с брифинга?
- » По какой причине она была отобрана на лист? (*Выход объема, подход к важному уровню сопротивления\поддержки, Выход на Нью Хай и т.д.*).

Описываю, как я брал эту акцию на пятиминутке. Описываю характер хода на пятиминутке, как давали позицию, как печатали. Если позиция прибыльная, то описываю, как торговалась бумага.

Записываю все свои мысли по поводу сопровождения позиции:

- » Где и почему я добавлялся к позиции? Где и почему сбрасывал?
- » Под влиянием, каких факторов я добавлял или сокращал позицию, и какие эмоции я при этом испытывал?

Записываю точку входа, стоп, добавление, точку выхода:

Пример:

Open: Buy Limit в 11:25 по 86.01\$ - Vol.: 200

Stop: 85.98 – Vol.: 200

Close: Sell Limit в 13:15 по 86.16\$ – Vol.:100

Sell Limit в 13:37 по 86.25\$ – Vol.: 100

Пишу выводы по этой сделке, чтобы по окончании рабочей недели можно было проанализировать всю торговлю в мелочах:

Как стоило входить? Правильно ли я вышел? Правильно ли добавлялся?

Указываю, была ли эта сделка по алгоритму или нет, чтобы вывести статистику корреляции между соблюдением алгоритма и прибыльностью сделок.

Если убыточная сделка была получена в результате не соблюдения алгоритма, то пытаюсь понять по какой причине я не придерживался алгоритма и что нужно сделать в дальнейшем, чтобы этих сделок не было. Если сделка была совершена по алгоритму, и все равно привела к убытку – ничего страшного, такое бывает!

**У тебя хороший алгоритм. Главное – его соблюдать!
ВЕРЬ ЕМУ!!!**

Записываю итог дня (*Нетом*)

Перехожу к записям в психологический дневник (*если это необходимо*)
Записываю все промежуточные наблюдения по наблюдаемым вопросам, если произошли какие-то существенные сдвиги по борьбе с какими-то недостатками или если появились новые проблемы.

САМОЕ ВАЖНОЕ – НЕ ВРАТЬ СЕБЕ!!!!

Еженедельный разбор сделок.

Разбор серии убытков

- 1.Общий анализ рабочей недели*
- 2.Анализ серии убыточных сделок (дней)*

1.Общий анализ рабочей недели.

Просматриваю все сделки за неделю. Читаю выводы по каждой сделке. На основании этих выводов пишу резюме. В нем должна быть установка на следующую неделю: на что нужно обратить внимание, что исключить из торговли, за чем наблюдать. Смотрю резюме прошлой недели и делаю записи о том, насколько успешно я соблюдаю свои установки и как это отражается на торговле. Дисциплину в себе нужно воспитывать!!!Полученное резюме недели нужно читать каждый день перед началом работы вместе с пересмотром скринов правильных сделок и паттернов из алгоритма.

2.Анализ серии убыточных сделок.

По алгоритму допускается максимум три убыточных дня подряд. После трех убыточных дней два дня не торгую.

Первый день: не смотрю рынок. Не открываю терминал, не смотрю графики. В этот день я не трейдер. Меняю обстановку, разгружаю голову.

Второй день: просматриваю скрины убыточных сделок, смотрю внутридневное состояние индексов на момент входа. Пытаюсь вычислить и понять, есть ли какой-то общий фактор, объединяющий всю серию убыточных сделок между собой. Если такой фактор есть, пытаюсь понять, что нужно сделать, чтобы этой проблемы не было в будущем. Все свои мысли записываю в психологический дневник и дневник сделок.

Релакс
Психологические тренинги



Релакс. Психологические Тренинги.

Цель:

Добиться состояния полного безразличия к незапланированному, повышенному убытку по отрицательной сделке.

Например:

очень плохо выпустило по стопу сквизом. Незапланированный убыток – всегда стресс. Не нужно сразу пытаться "отыгрывать убытки", ибо следующий убыточный трейд просто отправит меня отдыхать до следующей сессии.

Необходимо избавиться от стрессового состояния вызванного убыточным трейдом и выйти в «нейтральное состояние».

Ухожу в тихую, свободную комнату изолированную от любых посторонних шумов (улица, компьютер и т.д.) и выполняю приведенные далее упражнения:

Методы саморегуляции по методике Х. Алиева «Ключ».

Метод «Ключ» позволяет быстро выработать навыки саморегуляции, с помощью которых человек способен, во-первых, пресекать возникающий рост нервно-психического напряжения, во-вторых, снимать стрессовое состояние для выхода из кризисной ситуации, и, наконец, вызывать "нейтральное состояние" для "разгрузки" и "перезагрузки" мозга.

Прием 1. «Расхождение рук»

Вытяни перед собой руки и постарайся развести их в стороны, но так, чтобы они стали расходиться в стороны с равномерным мышечным усилием, как бы сами по себе, автоматически.

При этом ты почувствуешь, что как будто гора с плеч свалилась. Может быть, сразу, а может быть, и через несколько десятков секунд начнет появляться состояние внутренней легкости, при котором руки начнут расходиться в стороны еще легче и быстрее. Они двигаются уже как бы и по твоей воле как бы помимо воли. Как будто в невесомости, как будто им помогает какая-то сила. Это сила гармонии, возникшей между сознанием и организмом.

Когда руки начинают расходиться в стороны, твоя нервная система начинает успокаиваться, и ты чувствуешь, что начинаешь расслабляться и твое тело, возможно, начинает покачиваться. Это хорошо. Пусть руки расходятся, а тело — покачивается.

Мысли твои при этом начинают течь ровно и свободно. Думая о самых различных вещах на волне этого гармонизирующего ритма, ты обучаешься таким способом решать стрессовые проблемы на «спокойном уме».

Методы саморегуляции по методике Х. Алиева «Ключ».

Прием 2. «Схождение рук»

Разведи руки в стороны обычным механическим движением и настройся на их обратное автоматическое движение, друг к другу. Может быть, это действие тебе удастся легче. Если оно получается, повтори его несколько раз. А затем попробуй сделать первое движение — руки в стороны. Иногда при выполнении этих движений возникает чувство, что руки тянет какая-то сила. Подключение физических ощущений свидетельствует о глубине наступающего расслабления и возникновении «связи ума и тела». Расхождение и схождение рук надо повторить несколько раз, добиваясь как бы непрерывного движения. В моменты, когда руки как бы застревают, можно слегка подтолкнуть их. Или — улыбнуться. Если у тебя наступило состояние релаксации, отдохни в нем несколько минут. Во время выполнения этих приемов следует мысленно настроиться на улучшение самочувствия.

Методы саморегуляции по методике Х. Алиева «Ключ».

Прием 3. «Левитация руки»

Руки опущены. Можно смотреть прямо на руку, неотрывно, или же закрыть глаза. Ищи как легче. Но не бегай глазами по сторонам, иначе ты теряешь контакт с самим собой. Глядя прямо на руку, настройся, чтобы рука стала легче и стала, подниматься, «всплывать». Этот прием легче всего выполняется непосредственно после двух предыдущих.

Если он не получается, снова разведи и сведи руки, а затем попробуй поднять руку еще раз.

Когда рука начинает «всплывать», возникает масса новых ощущений. Надо запомнить эту «ниточку» внутренней связи, которая возникает у тебя между «волей и рукой».

Потом, пользуясь этим внутренним контактом, можно управлять не только движением руки, но и, например, снимать головную боль, регулировать артериальное давление крови, улучшать свое настроение, в общем — управлять своими внутренними процессами.

Методы саморегуляции по методике Х. Алиева «Ключ».

Прием 4. «Полет»

Когда при третьем приеме рука начала «всплывать», через несколько секунд дай возможность «всплыwania» и второй руке. Пусть они поднимаются. Пусть поднимаются как крылья. Помоги себе в этом приятными образными представлениями. Представь себе, например, что ты летишь, что руки — это крылья! Ты — высоко-высоко над землей. Чистое небо! Навстречу теплему Солнцу!

При этом позволь открыться твоему дыханию. Позволь себе дышать свободно. Позволь себе ощутить состояние полета. Это чудесное чувство, которого так часто не хватает нам на земле. Это состояние свободы! Ты можешь помочь себе ощутить это состояние воспоминанием о чувстве полетов во сне или других приятных ощущениях, связанных с радостью и раскрепощенностью.

Полное дыхание (йоговское)

Упражнение выполняется лежа на спине. Необходимо максимально расслабить тело, окинув его мысленным взглядом от макушки головы до кончиков пальцев ног и дать всем группам мышц установку на расслабление.

Особое внимание обращаю на лицо, живот, поясницу и другие участки тела, которые в связи с сидячим образом жизни расслабляются хуже всего.

Кладу одну руку на живот, другую – на грудь, чтобы контролировать движения живота и груди. Дыхание выполняется плавно, спокойно в ритме среднего пульса, без задержек и с равной продолжительностью вдохов и выдохов. Сознание во время дыхательной работы сконцентрировано на движениях живота и диафрагмы, не отвлекается на посторонние объекты.

В процессе этого дыхательного упражнения не надо думать о трейдинге, отрицательных позициях и незапланированных убытках. Нужно концентрироваться только на дыхании и расслаблении мышц тела.

Полное дыхание (йоговское)

1 часть

Нижнее «брюшное» дыхание

Выполняется нижней частью груди и легких. При этом живот совершает движение вперед и назад, а купол диафрагмы - вверх и вниз. Вдох - выпячивание живота (медленно, плавно округляется живот), на выдохе - живот втягивается как можно глубже.

2 часть

Среднее «межреберное» дыхание

Воздухом наполняется средняя часть легких. На вдохе ребра немного поднимаются, а грудь расширяется, приходит в движение диафрагма. Рука на животе контролирует чтобы он оставался максимально неподвижным в этой части дыхания.

3 часть

Верхнее «ключичное» дыхание

В верхнем дыхании принимает участие только верхняя часть груди и легких. При вдохе поднимаются ребра, ключицы и плечи, воздухом наполняются лишь некоторые отделы легких. Большая часть кислорода не достигает альвеол и не вступает в полезный газообмен.

Полное дыхание (йоговское)

4 часть

Полное дыхание

Полное дыхание состоит из трех фаз:

Первая фаза - нижнее, диафрагмальное дыхание,

Вторая – среднее, грудное дыхание,

Третья фаза – верхнее, ключичное дыхание.

Полный вдох:

- 1.Опускается диафрагма и выпячивается живот. Это способствует расширению нижних долей легких и наполнению их воздухом.
- 2.Расширяются ребра и наполняются воздухом средние доли легких.
- 3.Поднимаются ключицы, и воздух заполняет полный объем легких.

Полный выдох:

- 1.Втягивается живот и поднимается диафрагма – воздух выдавливается из нижних долей легких
- 2.Сжимаются ребра и грудная клетка в целом – от воздуха освобождаются средние доли легких.
- 3.Опускаются плечи и ключицы – воздух полностью выходит из дыхательной системы.

Полное дыхание (йоговское)

Результат:

Полное дыхание приводит в действие весь дыхательный аппарат. Оно обеспечивает оптимальное насыщение организма кислородом, стимулирует обмен веществ, увеличивает иммунные силы организма и помогает достичь глубокого расслабления.

Успокаивается нервная система, сокращается частота сердцебиений. Сознание перегружается и входит в "нейтральное состояние", в котором нивелируется негативное влияние внешней среды, и можно продолжать работать в эталонном, спокойном состоянии.