

## Стратегия с использованием стохастиков

Vlada Raicevic

Большинство трейдеров, использующих стохастики, используют в качестве сигналов пересечение %K и %D.

Давайте рассмотрим еще одну торговую стратегию для фьючерсного рынка, основанную на стохастическом индикаторе.

Традиционно считается, что, когда стохастические линии пересекают верхнюю или нижнюю границу, то акция входит в состояние перекупленности или перепроданности. Однако, такой индикатор, как стохастик, может указывать на подобного рода состояния в течение длительного времени, тогда как цена продолжает двигаться вниз или вверх. В этой статье мы намерены рассмотреть возможность получения сигналов входа в ситуациях, когда стохастик входит в крайние зоны.

Давайте представим, что при стохастике с параметрами (14, 3, 3) границы диапазона находятся на 75 и 25. Общая идея заключается в том, чтобы, когда быстрая линия пересекает отметку 75, открывать длинные позиции, тогда как при пересечении 25 - начинать шортить. Когда линии стохастика пересекаются, Вы закрываете позиции. На рисунке 1 вы видите, что длинная позиция открывается на 881.25, когда быстрый стохастик пересекает 75 % рубеж. Когда быстрая и медленная линии пересекаются, это дает сигнал к продажам (на 883.75).



Рисунок 1.

Мой совет покупать и продавать при пересечении этих линий, наверное, противоречит тому,

что Вы знаете о стохастиках, и при использовании тактики подобного рода Ваши нервы будут пошаливать. Поэтому, чтобы убедиться, давайте возьмем еще один пример. На рисунке 2 Вы видите больше возможностей для сделок - три для длинных и одну для короткой. Воспользовавшись всеми четырьмя сигналами, вы получите прибыль в 2.75 пунктов. Половина сигналов отработала, половина нет. Примерно такого я и ожидала, когда начинала работать над этой стратегией.



Рисунок 2

Теперь, когда мы наметили возможную стратегию, попытаемся усовершенствовать ее, чтобы улучшить результаты. Первое, что я попробовала сделать - это изменить границы диапазона с 75\25 на 65\35. Во-вторых, вместо того, чтобы выходить сразу же после того как стохастические линии пересеклись, почему бы не подождать пересечения границ в обратном направлении. Конечно же, в этой ситуации убыточных сделок будет больше, однако Вы можете таким образом поймать более длительный тренд, во время которого стохастики колеблются около пограничной зоны.

На рисунке 3 Вы видите, что для первого случая, когда границы расположены между 75\25, есть четыре сигнала для открытия длинных позиций, однако все эти сигналы ложные (ведущие к убыткам). Однако для второго случая, когда я задала для стохастика несколько другие параметры (14,3,2) и установил пограничные линии 65\35, один сигнал (шорт) (A) привел к 3-м пунктам убытков, тогда как два других сигнала B и C дали больше 19 пунктов прибыли.



Рисунок 3.

Этот чарт выглядит гораздо лучше. С его помощью отлично ловятся долгие движения цены. Однако, что же происходит, когда цена колеблется и тренда нет, в результате чего создается множество потенциальных входов, которые ведут в никуда. Подобного рода сценарий представлен на рисунке 4.

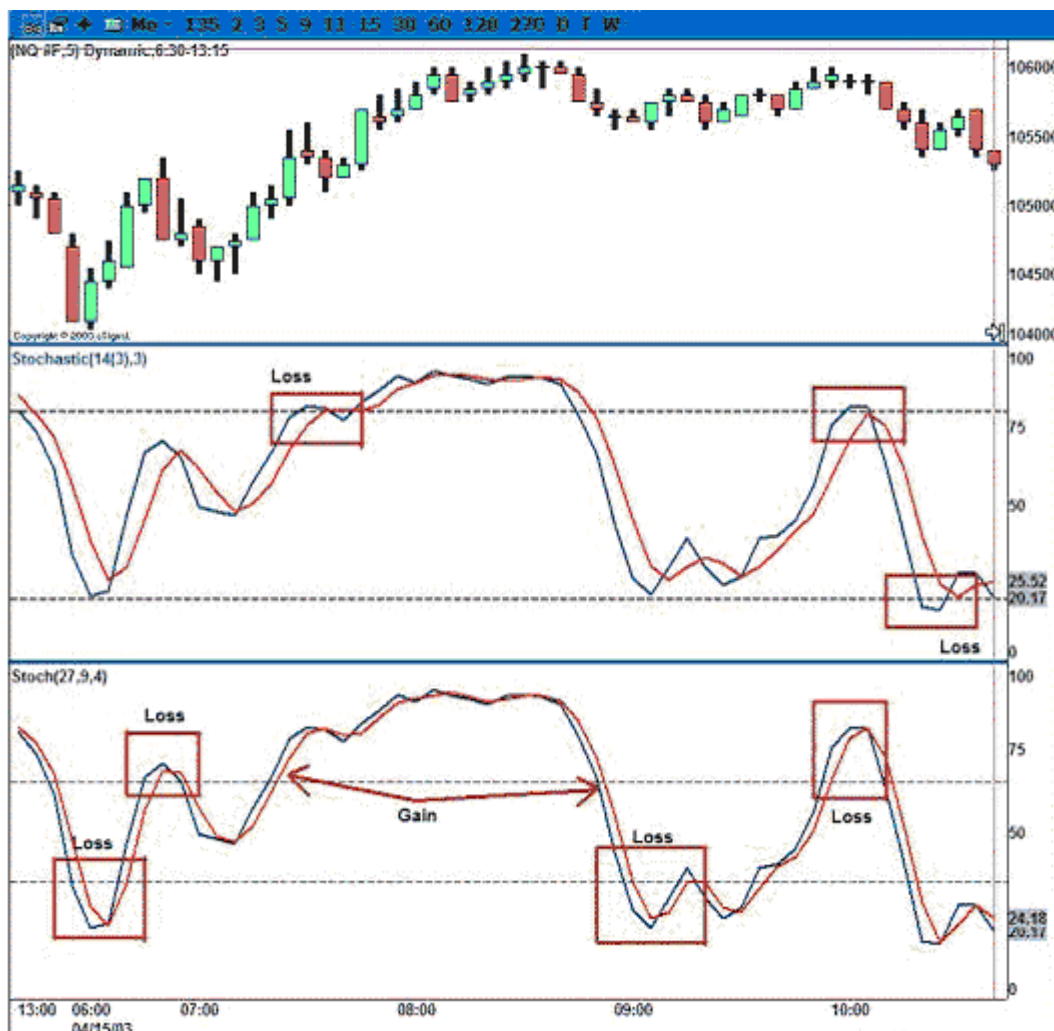


Рисунок 4.

Красные квадраты показывают точки пересечения пограничных линий и затем пересекаются снова, вызывая многочисленные небольшие убытки. В середине графика есть большая зона, где можно получить прибыль, однако итоги сделок здесь будут сведены на нет убытками.

Таким образом, хотя мы изобрели полезную стратегию, она зависит от ситуации и дает в разных случаях разные результаты.

Для следующего примера давайте возьмем пятиминутный график ES от 17 апреля. В первом окне вряд ли можно найти что-либо стоящее, поскольку при использовании этой системы (с обычными границами диапазонов) все сделки будут вести к убыткам. Для второго окна мы видим четыре возможные сделки, три из них ведут к убыткам. Однако общий выигрыш составляет 4.5 пунктов. Совсем не плохо для простой торговой системы!

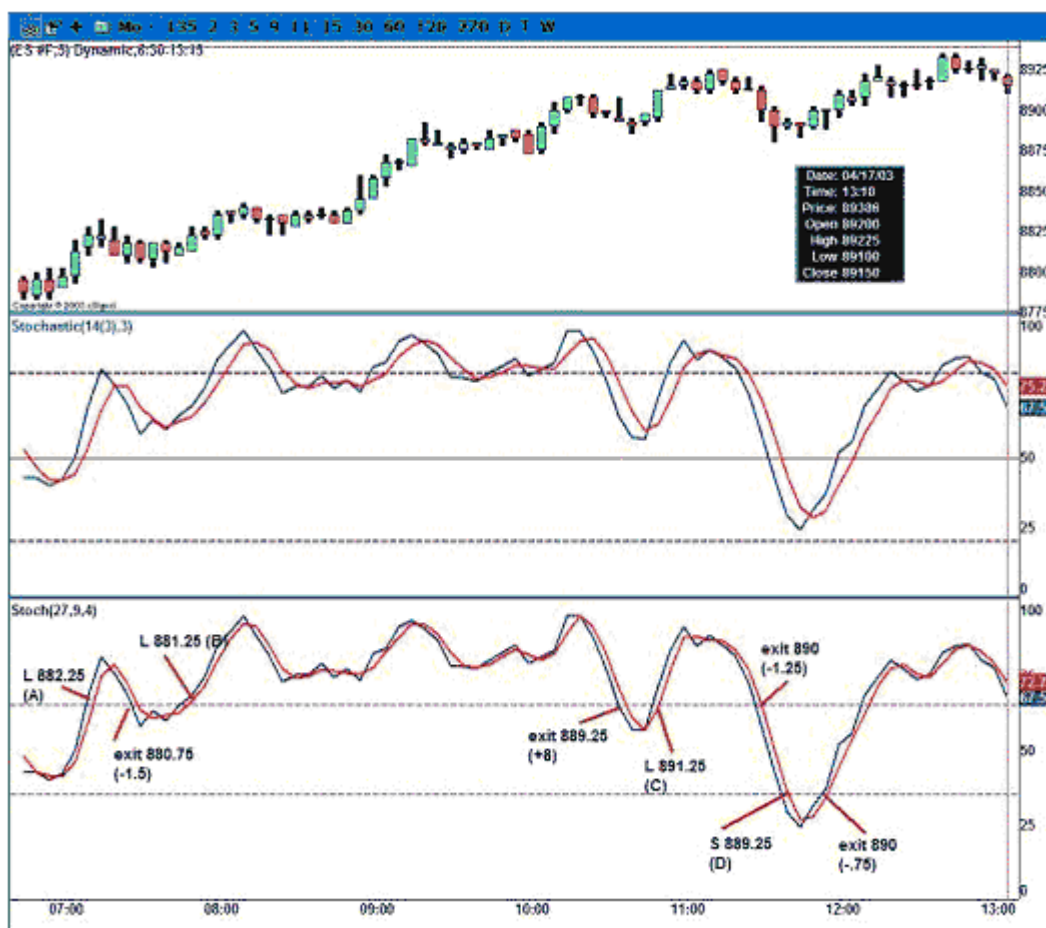


Рисунок 5.

В этот же день контракт NQ (рисунок 6) выглядел намного более бычьим, чем ES. Если бы Вы использовали предложенную мной систему в данной ситуации, то при доминировании одного тренда в течение всего дня, как это произошло в данном случае, вы получили бы возврат в 22 пункта, при вычете 4 пунктов убытков, вы заработали 18 пунктов.



Рисунок 6.

В целом, я пришла к выводу, что система действует, однако необходимо внести еще какие-то изменения, чтобы добиться более успешной торговли.

Давайте возьмем еще один пятиминутный график ES, который показывает нам точки входа, когда стохастики пересекают центральную линию и точки выхода, когда стохастики пересекаются друг с другом. На рисунке 7 дан прежний стохастик (14,3,3), тогда как предельные линии возвращены в первоначальное положение - на 75\35. В этот день возврат может составить 6 пунктов по итогам трех выигрышных и двух проигрышных сделок.





Рисунок 7.

Мы пришли к выводу, что пересечение центральной линии является более точным сигналом для принятия решений, и с большей вероятностью указывает на изменение тренда.

Вы также можете заключать сделки, когда стохастики пересекают крайние линии в обратном направлении. Т.е. если цена находится выше отметки 75 и пересекает ее вниз, то следует шортить, тогда как, если цена находилась ниже 25 и пересекла эту линию вверх, то можно открывать длинные позиции. Такая стратегия также дает смешанные результаты, иногда хорошие, иногда плохие.

А теперь, почему бы нам не попробовать соединить все три стратегии в одну? На рисунке 8 представлено, как работает этот метод.



Рисунок 8.

Проанализируем график. Стохастик находится ниже линии 25 и пересекает ее вверх. Вы открываете треть длинной позиции (а). Когда стохастик пересекает центральную линию, Вы добавляете еще треть позиции (В). Когда стохастик пересекает линию 75, вы добавляете еще треть позиции (с). Когда стохастические линии пересекаются, вы закрываете позицию.

Возможен другой подход. При пересечении % K и % D можно закрыть две трети позиции, при этом последнюю треть следует закрыть при пересечении линии 75 вниз. В приведенном примере пересечение этой линии происходит быстро, однако если движение цены спровоцировано длительным импульсом, последняя треть может принести Вам большой профит.

Надписи красным демонстрируют ту же самую стратегию только применительно к шортам. Мне хотелось бы остановиться на двух важных моментах. Красная стрелка показывает, что мы снова должны купить при пересечении линии 25 вверх. Однако, я бы не советовала совершать здесь сделку, поскольку этот момент совпадает с гэпом открытия вверх на графике движения цены. Поскольку гэпы - вещь очень ненадежная, я предпочитаю не предпринимать никаких шагов, когда сигнал дается гэпом. В этом случае лучше подождать второго сигнала после гэпа - т.е. пересечения стохастиком центральной линии.

Есть еще один момент, на который я хотела бы обратить внимание. Второй красной стрелкой отмечен момент после преодоления стохастиком отметки 75, когда стохастики пересеклись около 90. Это слишком высокая отметка для того, чтобы добавлять еще один длинный контракт к тому, который был добавлен при пересечении центральной линии. Я бы не советовала заключать сделки в тех случаях, когда стохастики находятся в зонах чрезвычайной перекупленности или перепроданности.

Вот еще один пример (рисунок 9). Вы открываете один длинный контракт, когда стохастик пересекает центральную линию (а) и открываете еще один длинный контракт при пересечении



линии 75 (b). Когда стохастики %K и %D пересекаются над отметкой 823, закрываете один из контрактов и удерживаете второй до тех пор, пока не происходит одно из двух:

1. Пересечение линии 75 вниз.
2. Пересечение стохастиков ниже последнего минимального пересечения.

На рисунке 9 я нарисовала красную горизонтальную линию от первой самой низкой точки пересечения стохастических линий. Когда они пересекаются ниже отмеченного уровня - это сигнал к закрытию длинной позиции.

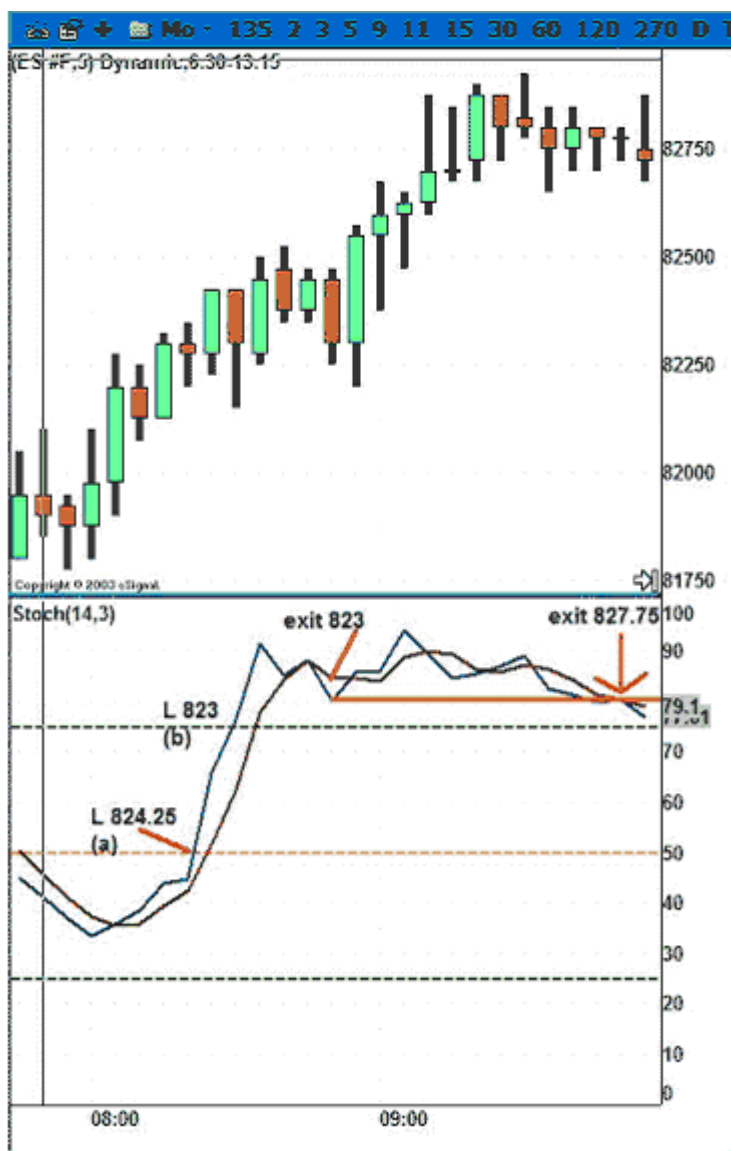


Рисунок 9.

На рисунке 10 приведен пример, когда две длинные позиции открываются в точках (a) и (b), однако на линии 75 открывать третью позицию не рекомендуется, поскольку бар закрылся выше отметки 90, что слишком высоко. Один контракт закрывается, когда стохастики пересекаются. Но есть еще один аспект, который нужно учитывать, если импульс сильный и стохастики пересекаются в направлении тренда, можно прикупить еще один контракт (c).



Рисунок 10.

## Резюме.

Предложенная нами стратегия представляет собой один из доступных вариантов анализа рынка. Используя ее в совокупности с другими техническими индикаторами, мы можем либо использовать, либо игнорировать генерируемые при ее помощи сигналы. На рисунке 11 вы видите канал регрессии (пурпурные линии), средние - 7 ета (голубая) и 13 ета (красная), индикатор RSI и среднюю 21 от RSI.

Пересечение стохастических линий (a) можно принять как сигнал к открытию длинных позиций, поскольку это подтверждает индекс RSI, пересекающий вверх среднюю. Второй сигнал к добавлению позиций подтверждается пересечением 7ета над 13ета. Третий длинный сигнал (C) подтверждается тем, что RSI продолжает идти вверх, а средние скользящие все еще расходятся.

Для большинства случаев здесь нет необходимости использовать стохастические индикаторы для выхода, поскольку и без них видно, как цена пробивает канал регрессии вверх, что свидетельствует о том, что она достигла топа, тогда как вторая пробивка канала создает негативную дивергенцию и служит сигналом для закрытия позиций.

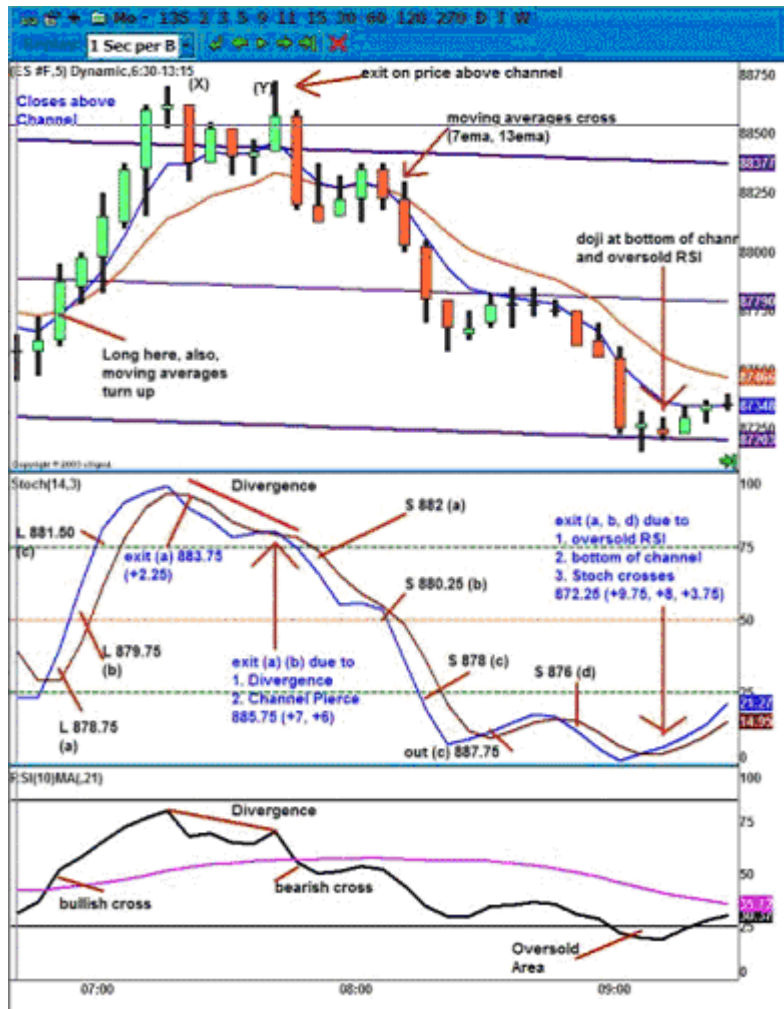


Рисунок 11

Игра в короткую является почти зеркальным отражением игры в длинную - RSI и средние подтверждают сигналы, сгенерированные стохастиками. Когда индекс RSI достигает зоны перекупленности, преодолев уровень 25 вниз, в канале регрессии цена достигает дна - два хороших сигнала для закрытия коротких позиций.

На дневном графике движения цены ES (рисунок 12) видно, как разные инструменты могут подтверждать либо опровергать тот или иной сигнал. Вы, в частности, можете увидеть, что третий длинный сигнал необходимо проигнорировать, в связи с тем, что пересечение стохастиком линии 75 совпало с достижением верхней линии канала регрессии. Вы можете также увидеть, что пересечение стохастиками линии 75 вниз также нужно проигнорировать, поскольку индекс RSI все еще находится выше средней скользящей, не подтверждая сигнала. После того, как в течение трех дней цена пыталась подняться, индекс RSI пересек среднюю, подав сигнал к продаже, при этом 7ема пересекла 13ему вниз, подтвердив этот сигнал.

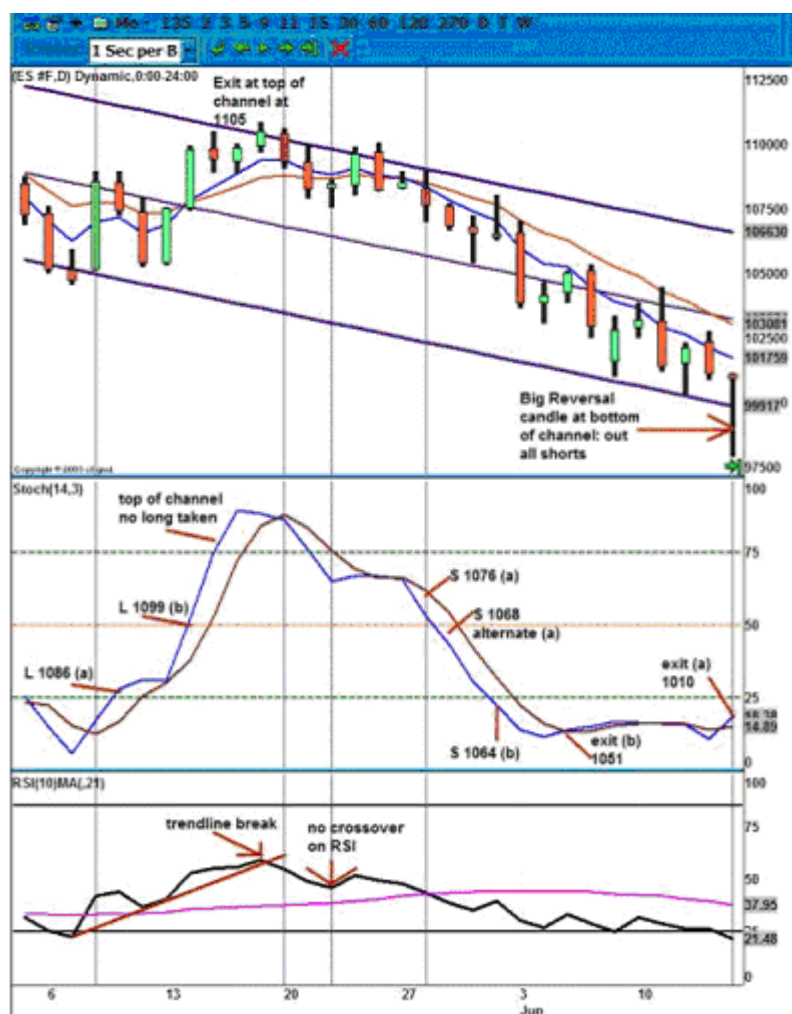


Рисунок 12

Вот и все, что я хотела сказать в отношении стохастиков. Сама по себе эта стратегия работает хорошо, тогда как количество ложных сигналов можно сократить, используя другие инструменты, такие, как каналы регрессии, средние скользящие и RSI. Экспериментируйте и ищите те варианты, которые подходят Вам больше всего.