

3 АЛЛИГАТОР НАШ КОМПАС И ПОМОЩНИК

Один из приемов доходной торговли - заключать только сделки с наибольшим потенциалом, и попадать в ситуации, которые характеризуются маргинальным потенциалом. Моя торговая группа, завершив пятнадцатилетние исследования, начала использовать науку о хаосе наряду с квантовой физикой, голографией, кибернетикой, нелинейной динамикой, теорией информации и фрактальной геометрией в мире фондовых и товарных сделок.

Начиная свои исследования, мы использовали суперкомпьютеры. В ходе процесса, включавшего миллионы итераций, мы изобрели систему, которая может работать на обычном персональном компьютере. Аллигатор, по существу, является компасом, который позволяет осуществлять сделки в определенном направлении, независимо от того, в какую сторону изменяется в данный момент цена.

Аллигатор - персонификация этого процесса. Он влияет на каждый сигнал в моем торговом арсенале. Мы продемонстрируем как сам этот ценный инструмент, так и методы его использования в торговле. В этой главе мы опишем Аллигатор - что он делает, как его строить, и как использовать его в торговле.

САМАЯ БОЛЬШАЯ ПРОБЛЕМА ТРЕЙДЕРОВ

Торговля - это, вероятно, наиболее волнующий способ заработать на жизнь и нажать состояние. Ты сам себе хозяин и злейший враг. Ты один борешься с своими собственными решениями. Если ты проиграл, тебе некого винить. Имейте в виду, вы принимаете ошибочное решение уже в тот момент, когда позволяете кому-либо другому принимать решения за вас или стараетесь подражать чьим-то действиям. С другой стороны, вы не обязаны никому говорить "спасибо". Вы обязаны только себе. Вы не обязаны соблюдать по отношению к кому бы то ни было требования политеса. Вы действительно "свободно скользите по лезвию вашей жизни".

Но здесь возникает проблема. Большую часть времени рынок никуда не движется. Только от 15 до 30 процентов времени рынок изменяется в соответствии с определенными трендами, и трейдеры, которые не находятся в биржевом зале, зарабатывают почти все свои прибыли на рынке, на котором можно выявить тренды. Мой дед обычно говорил: "Даже слепая курица будет находить зерна, если ее кормить каждый раз вовремя". Мы называем сделки по тренду "сделками слепой курицы", потому что все, что вы должны делать, это - "находиться там". В течение многих лет мы разрабатывали индикатор, который помогает "держать сухим порох в пороховницах" до тех пор, пока не наступит подходящий момент заключать эти "сделки слепой курицы".

Рис. 3-1 показывает типичное, "характерное" поведение фондового и товарного рынков. Типичный рынок от 70 до 85 процентов свой жизни никуда не двигается. В это время большинство трейдеров проигрывают. Возможно, единственные трейдеры, которые зарабатывают прибыли в это время - это трейдеры в биржевом зале и специалисты на фондовых рынках. Наиболее критическая точка изображена на Рис. 3-1. Это самая нижняя точка, как раз перед



Рис. 3-1. Типичный фондовый или товарный рынок.

- *Интегрированный подход к мониторингу движущей силы рынка (момента)*
- *Простой индикатор для торговли только для текущего тренда;*
- *Защитное средство, позволяющее не потерять деньги во время движения рынка в ограниченном диапазоне (коридоре цен).*

Рис. 3-2 Что такое Аллигатор?

большим повышением. Методы Profitunity, включая пять магических пульс¹, являются лучшими инструментами нахождения идеальной стартовой точки для торговли.

Проблема в том, что мы не хотим тратить время на вход и выход из рынка, который не движется. Если рынок никуда не движется, то возможности характеризуются словом НИГДЕ². Мы хотим изменить эти возможности и превратить их ЗДЕСЬ-СЕЙЧАС³. Наш метод движения, который позволяет переместить дефис на одну букву, и называется Аллигатором.

Аллигатор поможет нам попасть в реальный тренд и оставаться вне большинства сделок, которые заключаются в ограниченном диапазоне, съедающих наши прибыли. Давайте рассмотрим, что же представляет собой Аллигатор (Рис. 3-2). Позже мы изучим поведенческие модели Аллигатора.

ЧТО ТАКОЕ АЛЛИГАТОР?

По существу. Аллигатор - это комбинация Линий Баланса, использующих фрактальную геометрию и нелинейную динамику. Синяя линия (Челюсть Аллигатора⁴) на Рис. 3-3 - это Линия Баланса для временного периода, который используется для построения графика. Красная линия (Зубы Аллигатора⁵) - это Линия Баланса для значимого временного периода, который на порядок ниже. Зеленая линия (Губы Аллигатора⁶) - это Линия Баланса для значимого временного периода, который еще на один порядок ниже. Губы, Зубы и Челюсть Аллигатора показывают взаимодействие разных временных периодов. Поскольку тренды на рынке можно выделить лишь в течение 15-30 процентов времени, то мы хотим следовать трендам и не работать на рынках, изменяющихся только в пределах определенных ценовых периодов. Мы обнаружили, что Аллигатор может быть отличным руководством. Когда все три линии переплетены (См. Рис. 3-3), Аллигатор спит, и рынок движется в определенном диапазоне. Рынок отбирает назад то, что мы заработали во время изменения последнего тренда.

Цель Аллигатора состоит в том, чтобы:

1. Предоставить интегрированный подход для мониторинга движущей силы рынка;
2. Представить простой индикатор для торговли только в текущем тренде;
3. Создать защитное средство для того, чтобы не терять деньги во время движения рынка, ограниченного ценовым коридором.

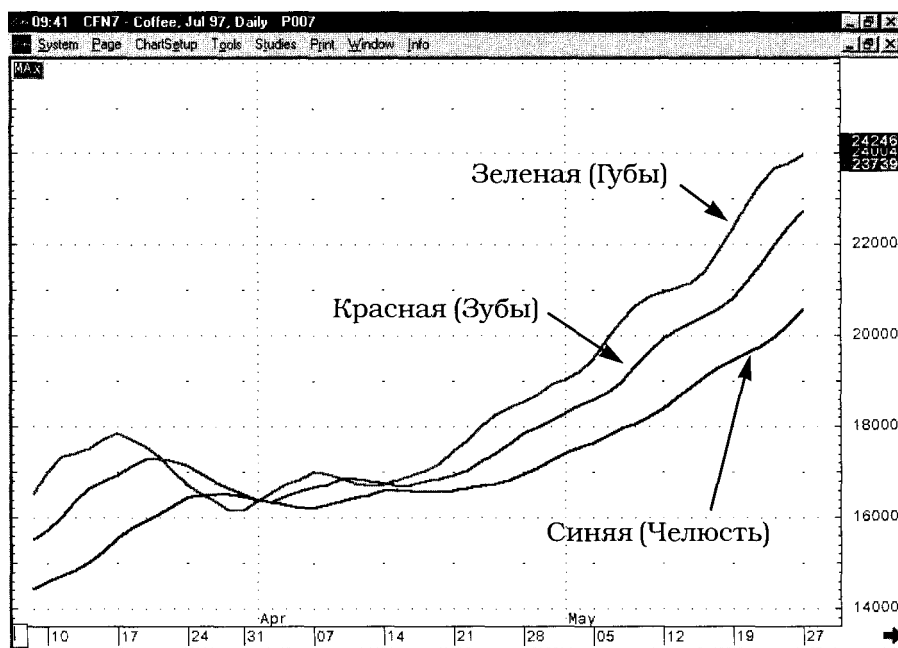


Рис. 3-3 . Анатомия Аллигатора 101

Вот какова наша базовая стратегия: мы хотим подождать чтобы тренд подтвердил себя, создав фрактал, который размещен выше/ниже Пасти Аллигатора (сигнал фрактала будет разъясняться в следующей главе). В идеале, но не всегда, все пять подъемов (или падений при нисходящем движении) должны находиться с одной стороны (выше покупок и ниже продаж) Синей Линии Баланса (Челюсть Аллигатора). Мы рассматриваем фрактал как момент нашего первого входа, а затем движемся в этом направлении в течение любого из сигналов пяти измерений, включая сделки в зонах.

Мы ставим нашу первую точку Остановки для Выхода (это не "Остановка и Разворот")⁷ непосредственно внутри Зубов Аллигатора (Красная линия), с помощью ордера "Стоп только по закрытии"⁸ для дневного интервала и "Стоп только по закрытии" для закрытия бара другой временной структуры. Если рынок движется в нашем направлении, мы отслеживаем остановку после того, как у нас получилось пять последовательных баров одного и того же цвета. Эта техника рассматривается в Главе 7.

АНАТОМИЯ АЛЛИГАТОРА 101

Полное объяснение Линии Баланса - что это такое и как это использовать, будет представлено в Главе 8. По существу, Синяя Линия Баланса - это линия цены, которая была бы справедлива, если бы не поступала новая информация. Оригинальные расчеты для этой Синей Линии Баланса были произведены математически, с использованием супер-универсальной вычислительной машины. Она была построена путем вычерчивания 13-периодной сглаженной скользящей средней, которая имеет смещение на 8 баров в будущее. Повторяю, мы будем называть эту линию Челюстью Аллигатора.

Зубы Аллигатора - это Линия Баланса для временного периода, который лежит на один порядок ниже. Компьютер показывает точный временной период (приблизительное соотношение - пять к одному). Если синяя линия построена для дневных значений, то Красная линия (Зубы) построена для часовых значений. Красная линия строится с использованием 8-периодной сглаженной скользящей средней, которая имеет смещение на 5 баров в будущее. Зеленая линия (Губы Аллигатора) характеризуется времен-

Челюсть (Синяя линия): Это Линия баланса текущего промежутка времени, используемого для построения графика. Это - 13-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 8 баров в будущее.

Зубы (Красная линия): Это Линия баланса для предыдущей, более низкого порядка, значимой временной структуры. Это - 8-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 5 баров в будущее.

Губы (Зеленая линия): Это Линия баланса для еще более короткого промежутка времени. Это - 5-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 2 бара в будущее

Рис. 3-4. Построение Аллигатора.

ным периодом еще более низкого порядка. Она строится как 5-периодная сглаженная скользящая средняя, которая смещена на 3 бара в будущее.

Таким образом, наша конструкция выглядит следующим образом (Рис. 3-4):

Синяя линия - 13-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 8 баров в будущее.

Красная линия - 8-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 5 баров в будущее.

Зеленая линия - 5-периодное сглаженное скользящее среднее, смещенное на 3 бара в будущее.

Эти средние можно рассчитать на большинстве машин, обеспечивающих получение данных с рынка. Эта функция также доступна в нашем собственном программном обеспечении "Мечта инвестора"¹⁰. Средние создают три разных временных структуры Линий Баланса на одном и том же графике.

АЛЛИГАТОР НА ЦЕНОВОМ ГРАФИКЕ

Рис. 3-5 - это тот же график, что и на Рис. 3-3, но с добавлением цен. Обратите внимание: когда ответвляющиеся скользящие средние переплетены. Аллигатор спит, и чем дольше он спит, тем более голодным он становится. Когда он просыпается после длительного сна, то он очень голоден и охотится за ценой (пища Аллигатора) значительно дольше, потому что, чтобы наполнить его желудок, ему требуются более высокие цены.

Когда Аллигатор получил достаточно, он начинает закрывать свою пасть и теряет интерес к еде. (Потребность в еде характеризуется открытой пастью; сон - закрытой, или переплетенной). Это время, когда вы готовитесь собирать прибыли в результате развития тренда. Ничего не делайте, когда Аллигатор находится в состоянии дремоты, и возвращайтесь на рынок, лишь тогда, когда Аллигатор начинает просыпаться.

На Рис. 3-6 представлен график акций Coca-Cola. Во время августа и сентября, единственными рациональными действиями на

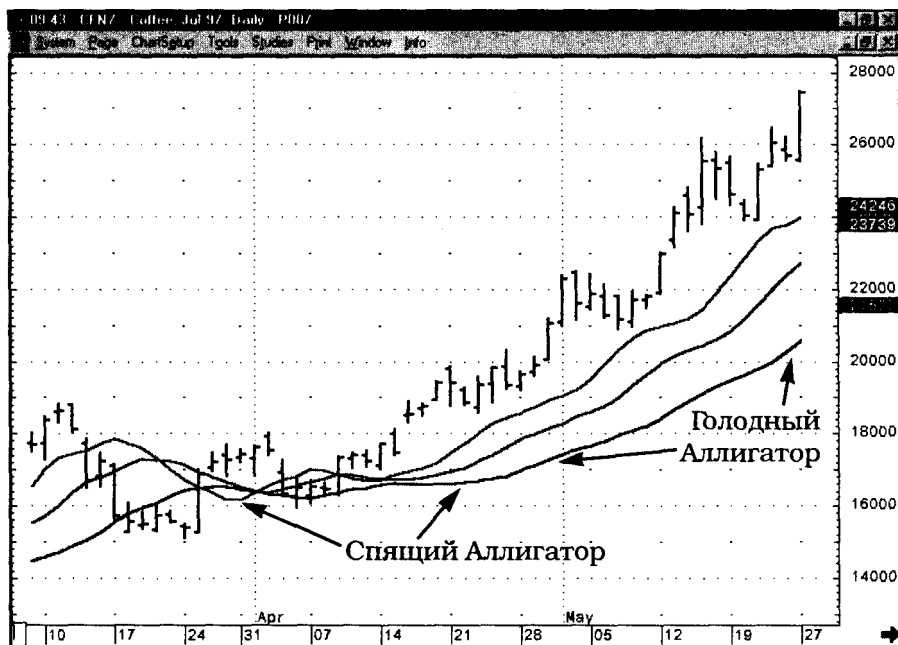


Рис. 3-5 Аллигатор на ценовом графике Кофе

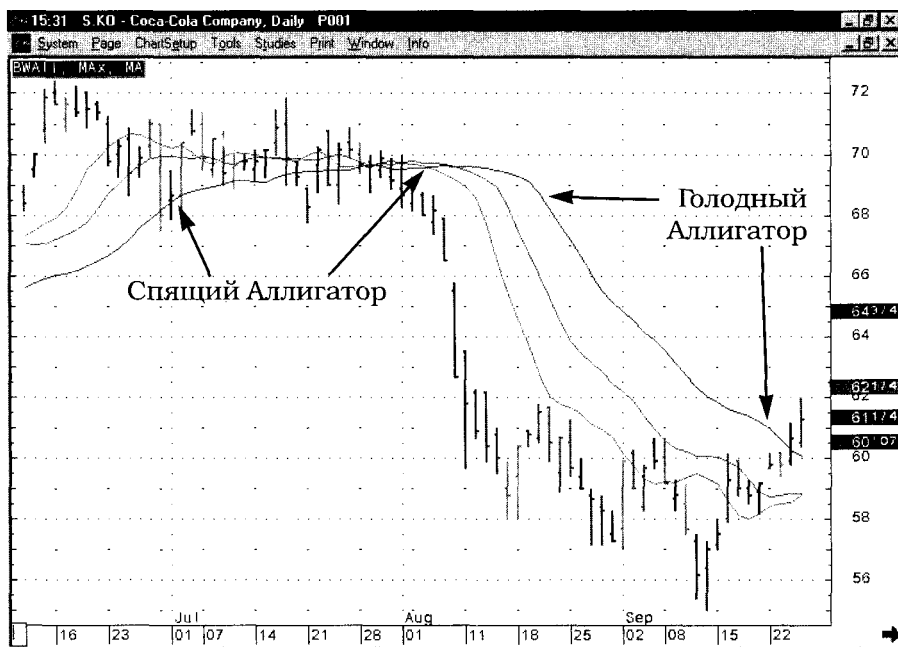


Рис. 3-6. Аллигатор на медвежьем графике акций Coca-Cola

рынке было занятие коротких позиций. Заметьте, что Пасть начала закрываться в сентябре, говоря нам, что пора собирать прибыль и ждать, когда Аллигатор уснет.

Мы обнаружили, что метод Аллигатора позволяет уменьшить количество убыточных сделок, и улучшает наш показатель выигрыша-проигрыша. Он позволяет избегать ситуаций, когда рынки находятся в неспокойном состоянии, и вводит нас в каждый значительный тренд.

ТОРГОВЛЯ ПРИ ПОМОЩИ АЛЛИГАТОРА

Рассмотрим стратегию торговли при помощи Аллигатора. Когда Челюсть, Зубы и Губы закрыты или переплетены, мы знаем, что Аллигатор собирается спать или уже спит. Когда он спит, его голод увеличивается. Чем дольше он спит, тем более голодным он будет, когда проснется. Когда он просыпается, первое, что он делает, - это



Рис. 3-7 Торговля при помощи аллигатора

открывает свою Пасту и начинает звать. Затем он начинает чують запах пищи: мясо быка или мясо медведя, и начинает за ним охотиться.

Обычно мы не входим в рынок, когда Аллигатор спит. Ведь мы хотим поставить либо на быков, либо на медведей, в зависимости от того, кого преследует Аллигатор. При нашем первом входе мы ждем до тех пор, пока внутри челюсти не появится фрактал. Сигнал фрактала будет объясняться в Главе 4. Вы можете видеть его на Рис. 3-7, как первый "л", как раз под номером 1 в левой части графика. Это первый фрактал вверх. Обратите внимание на то, что имеются еще пять сигналов фрактала на покупку, которые использовались позднее во время этой повышательной тенденции. Рис. 3-7 - это график Кофе. Рис. 3-8 показывает тот же тип ситуации на графике акций Dell Computer. В этой книге вам будут представлены как фьючерсные графики, так и графики акций. Различий в торговой стратегии при использовании концепций Теории Хаоса - нет.

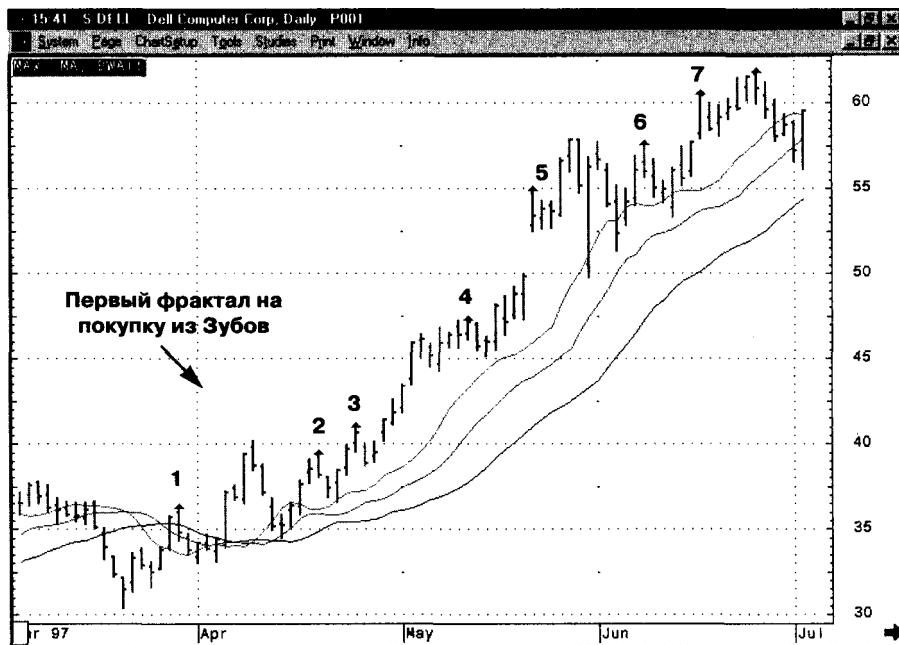


Рис. 3-8 Торговля вне Пасты на акциях Dell Computer

ПОВЕДЕНИЕ АЛЛИГАТОРА

Наша торговая стратегия не в том, чтобы не торговать пока не появится первый фрактал вне Пасты. Этот вход в рынок будет полностью разъяснен в следующей главе. После появления первого фрактала, мы используем любой и каждый сигнал всех пяти измерений в этом направлении. Например, если цена выше Пасты Аллигатора, то мы будем использовать только сигналы на покупку и не будем занимать короткие позиции. При восходящей тенденции у нас будут остановки для фиксирования прибыли. При нисходящей тенденции мы будем использовать только сигналы к продаже, которые лежат ниже Пасты Аллигатора, и покупать будем только для

того, чтобы выйти из позиции, а не для того, чтобы занимать длинные позиции. Процедуры по выходу подробно разъясняются в Главе 9.

Это очень просто. Выше Пасти мы открываем позиции на покупку, а ниже Пасти мы занимаем короткие позиции. Это гаранти-

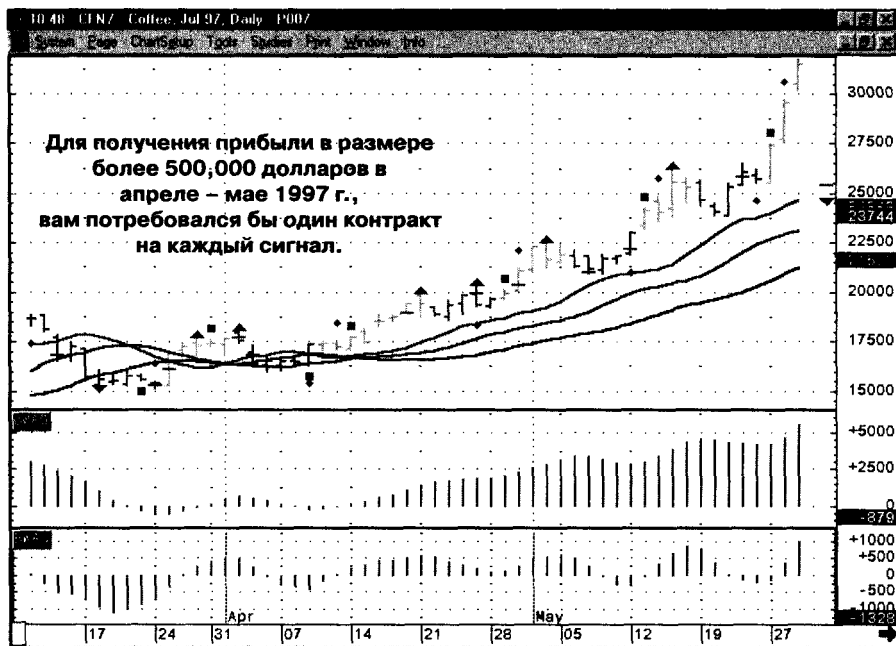


Рис. 3-9. Торговля на рынке Кофе при помощи всех пяти измерении за период Апрель - Май.

рует, что мы не пропустим никакого тренда, и найти проблемы будут сведены к минимуму.

Другое упрощение, к которому ведет использование Линии Баланса, - отпадает необходимость в точном подсчете Волн Эллиотта при торговле. Если текущая цена находится за пределами Пасти Аллигатора, нас захлестывает импульсивная волна того или иного уровня. Если цена колеблется вокруг Линии Баланса, мы находимся в реактивной волне того или иного уровня.

Рис. 3-9 и 3-10 наглядно иллюстрируют возможности Аллигатора как навигатора и помощника в излечении прибыли при торговле фьючерсами и акциями.

Оба рисунка иллюстрируют возможности комбинирования всех пяти измерений и использования Аллигатора в качестве компаса. Аллигатор ясно показывает, какие сигналы использовать, а какие нет. Рис. 3-10 показывает все сигналы фракталов. Удивительного осциллятора (АО), Ускорения (АС) и Линии Баланса. Вы можете видеть, как агрессивные дополнительные действия во время трендо-вого движения дают вам возможность получить экспоненциаль-



Рис. 3-10 Торговля на S&P при помощи всех пяти измерений, в течение трех с половиной месяцев, по дневному графику.

ный рост прибыли. (АО и АС будут рассмотрены в последующих главах).

Движение цен на Кофе (Рис. 3-9), которое длилось менее двух месяцев, обеспечило прибыль в размере 500,000 долларов, на основе заключения одного контракта для каждого сигнала. Эта пятимерная стратегия позволяет достичь прибыли в 3-5 раз выше изменения цены в ходе тренда. Другими словами, если изменение цены во время тренда составило 200 пунктов, наша цель - получить от 600 до 1,000 пунктов на основе правила заключения одного контракта на каждый сигнал.

График на S&P (Рис. 3-10) показывает сигналы, которыми можно было бы воспользоваться, применяя Аллигатор при торговле всего лишь в течение трех месяцев S&P 500 на основе дневного графика, без сделок внутри дня. Надо отметить, что здесь приводятся особенно хорошие результаты, но использование этих методов подтвердило свою гарантированную рентабельность. Все эти сигналы легко распознать. Они могут производиться автоматически, при использовании нашего программного обеспечения, которому доступно использование большинства форматов данных.

РЕЗЮМЕ

Эта глава представила идею использования Аллигатора для формирования входа и выхода, а также для снижения потерь. То, что движет фондовыми и фьючерсными рынками - это трейдеры, которые реагируют на новую поступающую информацию (Хаос). Линия Баланса - это линия, на которой находился бы рынок, если бы не поступала никакая новая информация. Другими словами, рынки движутся только тогда, когда присутствует Хаос. Если бы не было Хаоса (новой поступающей информации), рынки были бы статичными. Наша работа состоит в том, чтобы выявить характеристики этой новой поступающей информации и использовать ее для получения дополнительных преимуществ во время торговли.

В следующих пяти главах мы изучим каждое из пяти измерений рынка, а также - как их использовать для получения прибыли. В *Главе 9* мы применим Теорию Хаоса для выжимания максимального количества прибыли из каждой сделки. Теперь вы должны хорошо понимать, как действует Аллигатор и три различные Линии Баланса. Вы должны также уметь определить, когда Аллигатор спит и когда он охотится.