

ТАРГОВЫЙ АЛГОРИТМ

Повестка дня

(8:00 – 9:30 NY)

15:00 – 16:30 (+2 UTC) – Домашнее задание

(9:30 – 16:00 NY)

16:30 – 23:00 (+2 UTC) – Торговля. Главное время до 12ч по NY. Если есть возможности и план на весь день, торгуем всю сессию.

(16:00 – 17:00 NY)

23:00 – 24:00 (+2UTC) – После торговли делаем скриню всех своих сделок (плюсовых и минусовых)

Домашка

SPY: Отрываем график „S&P 500“, рисуем уровни на дневном графике, определяем тренд. Потом переключаем по меньше time frame (30min) и смотрим какие уровни ждут нас сегодня из этого сможем сделать вывод как будет день. (импульсивный или мертвый в рейндже) Из этого делаем вывод что нам лучше сегодня торговать – пробои, отбои, может торговать коридоры или совсем не торговать.

Смотрим как S&P 500 на премаркете. Если он сдвинулся (-5 - +5), это нейтральная зона и скорее всего не будет импульса на открытие.

1 day in play: Отрываем *briefing.com*, закладку earnings. Копируем бумаги за сегодня, которые отчитываются. И бумаги которые отчитались вчера после закрытия рынка. Потом копируем бумаги из earnings-guidance (некоторые бумаги могут совпадать). Смотрим какие IPO выходят в этом месяце. Потом отбираем бумаги, ищем гепы, активность на премаркете. Определяем характер в бумаге и смогу ли я в ней высидеть, какие риски, четкие ли точки для входа и выхода бывают в этих бумагах и так далее.

2day in play: отрываем *finviz.com* и в скреенере вводим такие параметры:

County – USA,

Industry – Stocks,

Average volume – over 500k, (750k – когда большая волатильность на рынке)

Ralative volume – over 1,5.

Нам нужно найти бумаги в которых был повышенный объем которые вчера мы пропустили. Как правило большие движения делают институционалы. Большая вероятность что такие бумаги еще могут активно двигаться 3-4 дня.

Исключение – если рынок был активен, он мог за собой потянуть много бумаг, по этому, в те дни, когда, например индекс сильно падал отбирать сильные бумаги, которые на этом падение выросли и наоборот.

Меж отчетный период

К домашнему заданию добавляются „high beta“ бумаги.

Еще смотрю бумаги, где нравятся дневки и бумаги в день неплохо ходят. В таком случае take profit очень будет зависеть от ATR.

County – USA,

Industry – Stocks,

Average volume – over 500k,

Average True Range – over 2,5.

Приоритет бумаг:

Просмотрев все бумаги с домашки, делаю приоритет бумаг, на которые буду смотреть в первую очередь из за большой вероятности хорошего хода.

Приоритет 01	Приоритет 02	другие
AHP	HZNP	IBM
CAT	TRV	KSU
...

Уровни, на которые я обращаю внимание:

- Уровень/откат, после которого образовался новый high или low
- Day low, high, close
- Уровни премаркета
- Длинная консолидация на дневном графике.
- Уровень где был критический объем (volume spike)

Когда делаю сделку:

- В первую очередь у меня должна быть идея для этой бумаги. Не всегда я отбираю в лонг или шорт, но есть четкие уровни, возле которых я буду знать, что мне делать.
- Должен увидеть знакомую формацию. Если в моменте появляется двоякая ситуация или я не знаю что делать, лучше подождать или наторговать эту бумагу.
- В момент входа обращать внимание на SPY indeks.
- Лично для меня очень важно в моменте смотреть в ленту (time and sale).
- Раньше еще смотрел на индикатор vwap.
- Принять к сведению риск менеджмент.

Risk management

Day stop lost: ~50-100\$ (можем разделить, часть для утреннего импульса, другая часть для остальной части дня)

Stop lost для сделки 0,01-0,15\$ (если виден хороший потенциал но стоп будет 0,25-0,30\$, в позицию заходит 100-200 бумаг, не больше и это должен быть не утренний трейд)

Иногда могу взять риск побольше, если сделал подушку безопасности.

Риск/прибыль – от 1/5 (минимум).

Правило:

- Не открывайте сделки в сторону тренда, если бумага прошла почти весь ATR, будем искать разворот. Исключение, если в бумаге увеличенный объем, в этом случае она может ходить намного больше, чем обычно.
- Если я получаю прибыль в размере более 120\$, не позволяйте себе терять более 30% этой суммы. То же самое происходит, если вы делаете 3 отрицательных сделки подряд. В случае потери, выключите платформу и идите отдыхать.
- Если прибыль достигает 120 долларов, я даю себе шанс рискнуть и увеличить сумму денег. Но в случае неудачи я должен оставить не менее 10 долларов прибыли и отключить платформу.
- В течение отчетного периода старайтесь зарабатывать более 300 долларов в день, плохой день позволяет себе потерять 50-100 долларов (в зависимости от ситуации)
- Хорошему трейдеру описывается не то, сколько он зарабатывает в хороший период, но сколько он теряет в плохом.
- Всегда есть завтра, самое худшее произойдет, когда у вас не будет завтра. Имейте в виду, что один положительный день может вытянуть несколько минусовых дней. Поэтому не нужно беспокоиться и делать еще больше минуса. (Не рисковать всем депонированием, не отключать управление рисками, уменьшать убытки)
- Сделки отковать от риска.
- В сезон отчетов делать акцент на бумагах, которые ходят, а не болтаются пол дня на одном месте.

Wachlists

The screenshot displays five watchlist windows and an activity log window. Each watchlist window contains a table of stock data with columns for Symbol, Trade, High, Low, Net Change, and % Change. The activity log window shows a series of connection events.

WatchList [Prioritet 01.txt]

Symb...	Trade	High	Low	NetCha...	%Ch...
JACK	97.3217	98.29	97.03	0.0117	0.01
PRGO	84.93	85.78	84.55	0.00	0.00
CCE	40.64	40.86	40.54	0.00	0.00
LYV	43.00	43.855	43.36	-0.50	-1.15
DDS	57.5369	58.19	54.52	0.0069	0.01

KSS	46.0645	46.12	44.74	-0.0055	-0.01
M	21.58	21.65	21.18	0.05	0.23
YY	80.72	80.68	75.96	0.20	0.25
CBI	16.37	16.42	15.87	0.00	0.00
DOOR	66.35	67.40	65.25	0.00	0.00

WatchList [Earnings.txt]

Symb...	Trade	High	Low	NetCh...	%Ch...
EAT	32.1839	32.52	32.02	0.0039	0.01
DIN	41.04	41.19	39.83	0.00	0.00
ELF	19.28	19.62	18.84	0.00	0.00
PEGA	59.35	59.65	57.80	0.00	0.00
PBYI	104.50	104.85	102.65	0.00	0.00
QTM	6.16	6.185	5.88	0.00	0.00

WatchList [2 day in p...]

Sy...	Trade	High	Low	Net...	%C...
AOI	63.30	64.68	62.72	-0.50	-0.78
RUB	51.80	53.03	49.60	0.11	0.21
ELP	43.4148	44.00	43.24	-0.00...	-0.01
FII	41.44	41.8...	41.35	0.00	0.00
ZNP	12.32	12.44	12.12	0.00	0.00
YOK	45.45	47.40	44.80	0.30	0.66
OL	130.48	130.68	129.99	0.00	0.00
WPH	111.00	109....	107.3...	2.54	2.34
F	10.43	10.51	10.30	-0.07	-0.67
ORS	46.16	46.24	45.455	0.00	0.00
L	88.42	89.05	88.00	0.00	0.00
EAS	12.39	12.42	12.33	0.00	0.00
V	75.10	81.41	74.02	0.51	0.68
PHI	38.40	38.46	37.45	0.00	0.00
IAR	107.86...	108.07	107.00	-0.01...	-0.01
AA	21.73	21.81	21.50	0.15	0.70
AGP	22.33	22.54	22.29	0.00	0.00
WLO	30.85	31.16	30.25	0.02	0.06
VHC	44.69	45.33	42.91	0.00	0.00

WatchList [Hig...]

Sym...	Trade	Previ...	%Chan...
AAP	96.25	95.59	0.69
ADS	216.76	216.76	0.00
AGN	204.50	204.65	-0.07
ALK	75.50	74.75	1.00
ALXN	142.82	142.82	0.00
AMG	184.97	184.97	0.00
AMGN	185.76	185.76	0.00
AMP	142.92	142.92	0.00
AMZN	952.00	955.10	-0.32
ANET	192.37	191.05	0.69
ANTH	182.86	182.86	0.00
AVB	179.222	178.52	0.39
AVGO	239.50	239.24	0.11
AVI	163.99	163.99	0.00
BA	256.61	256.45	0.06
BCR	318.63	318.63	0.00
BDX	193.06	193.06	0.00
BIDU	241.00	240.57	0.18
BIIB	317.40	318.46	-0.33
BLK	435.49	435.49	0.00
BLUE	128.75	128.75	0.00
BURL	89.7692	89.78	-0.01
CFR	91.0009	90.99	0.01
CHTR	360.2568	360.30	-0.01
CI	182.74	182.74	0.00
CMG	314.31	314.31	0.00
CMI	167.98	167.98	0.00
CP	168.25	168.25	0.00
CXO	127.06	127.06	0.00
DPZ	197.2337	197.21	0.01
DY	82.6999	82.69	0.01
EOG	94.55	94.55	0.00
EQIX	441.66	441.66	0.00
EXP	105.8327	105.82	0.01
EXPE	145.77	145.77	0.00
FANG	95.74	95.74	0.00
FDX	219.72	220.00	-0.13
FFIV	119.73	119.73	0.00
FLT	153.67	153.67	0.00
GD	205.41	205.41	0.00
GS	231.15		

ActivityLog

```

11:04:26.8166994 Connected to HTServer
11:04:26.5489863 Connected to ExecutionServer
11:04:25.7346393 Connected to DataServer
11:04:25.2031034 Got ConnectionSwitch...
    
```

Я использую 5 wachlist'ов

Красный Приоритет№-1

Бумаги, которые отчитываются сегодня.

- Первый wachlist – бумаги на которые у меня есть идея на сегодняшний день. (смотрю эти бумаги с утра и часто торгую утренние импульсы)
- Второй wachlist – тоже бумаги, которые отчитываются сегодня, но нет идеи для утра, эти бумаги буду смотреть 30-40min после открытия.

Синий

Здесь находятся IPO и бумаги которые смотрю несколько недель (их торгую очень редко), бумаги для эксперимента.

Желтый

„2day in play“ list. Бумаги которые уже отчитались. Здесь бумаги лежат 3-4 дня.

Зеленый

„High beta бумаги“ – Чаще всего за ними слежу, когда намечается хилый день и нету хороших бумаг в приоритете.

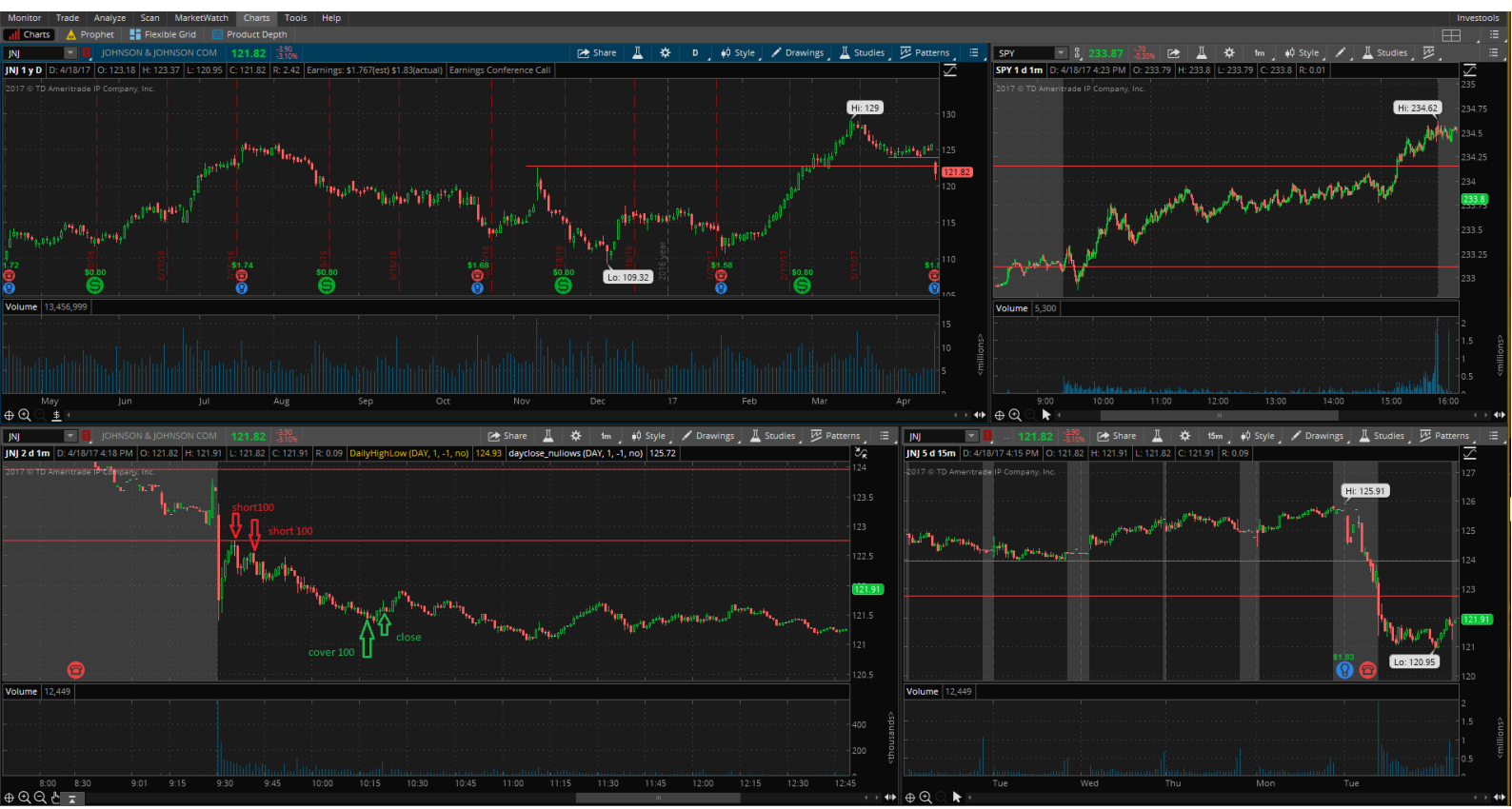
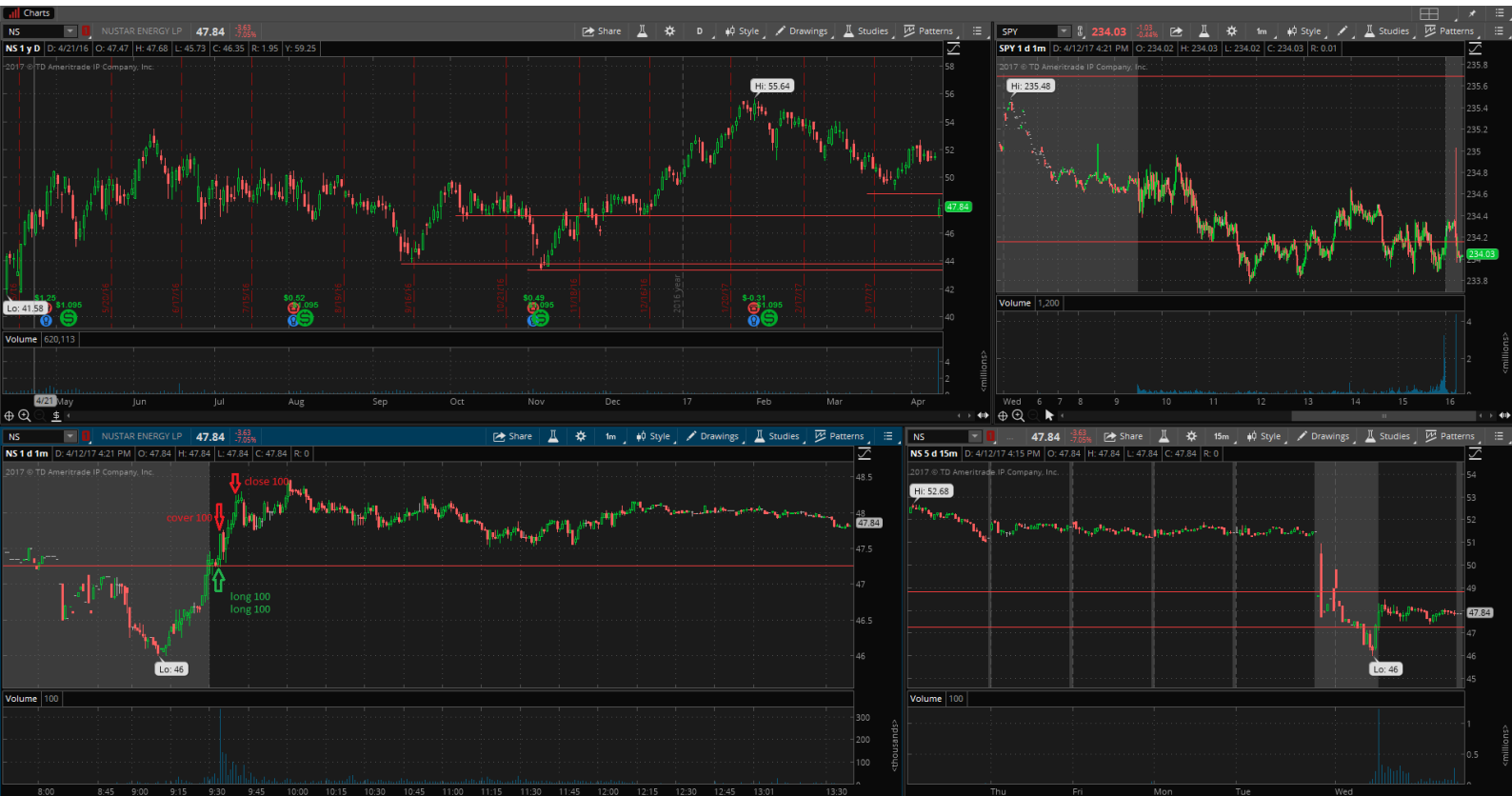
Рабочие этапы

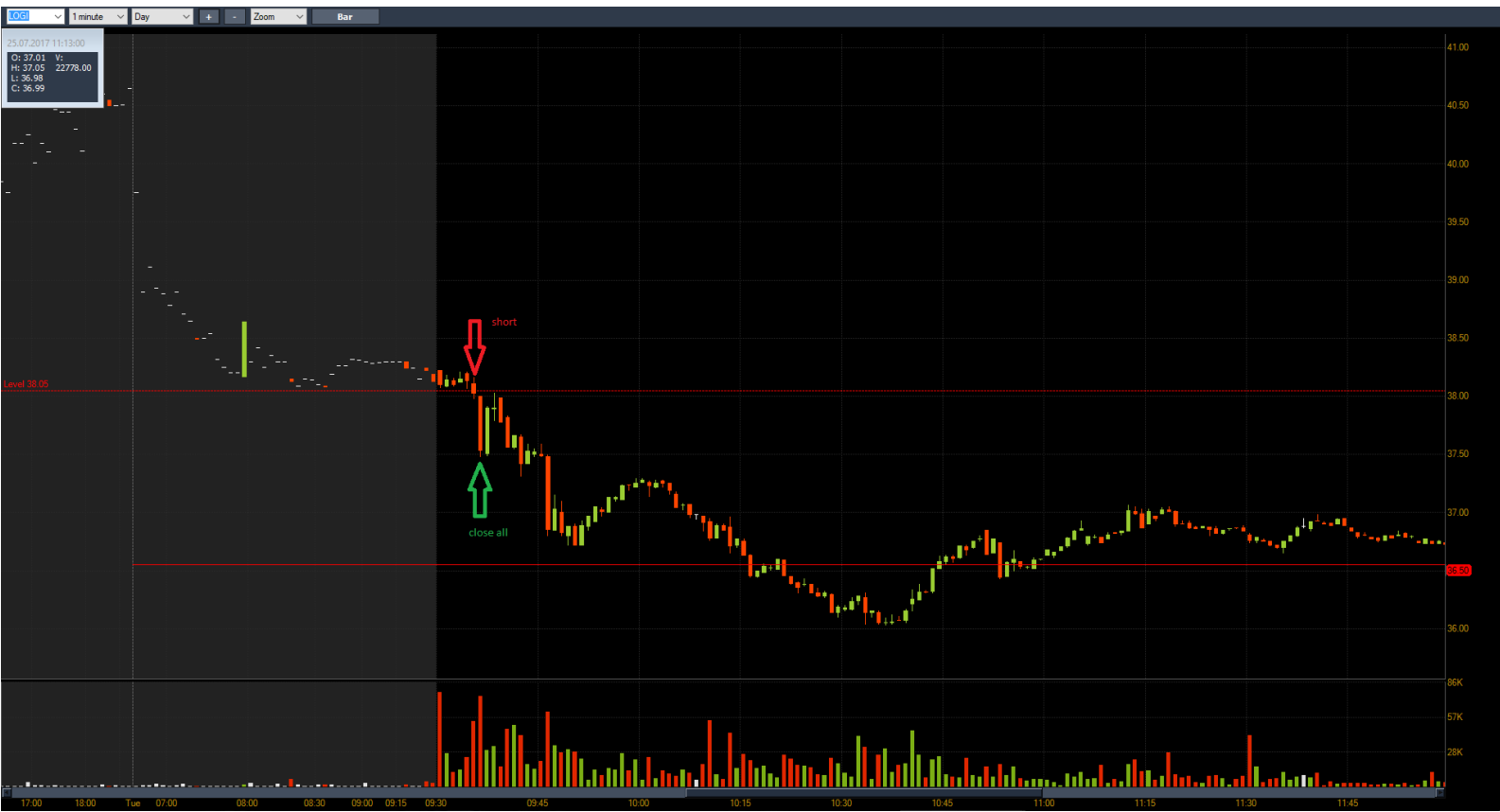
09:00 – 09:30 Утренние импульсы

Смотрю на уровни премаркета, цену закрытия вчерашнего дня, откладываваю сильные уровни на дневках

Смотрим в моменте бумага селение или слабее рынка SPY

Ленту (Time and sale) смотреть обязательно.

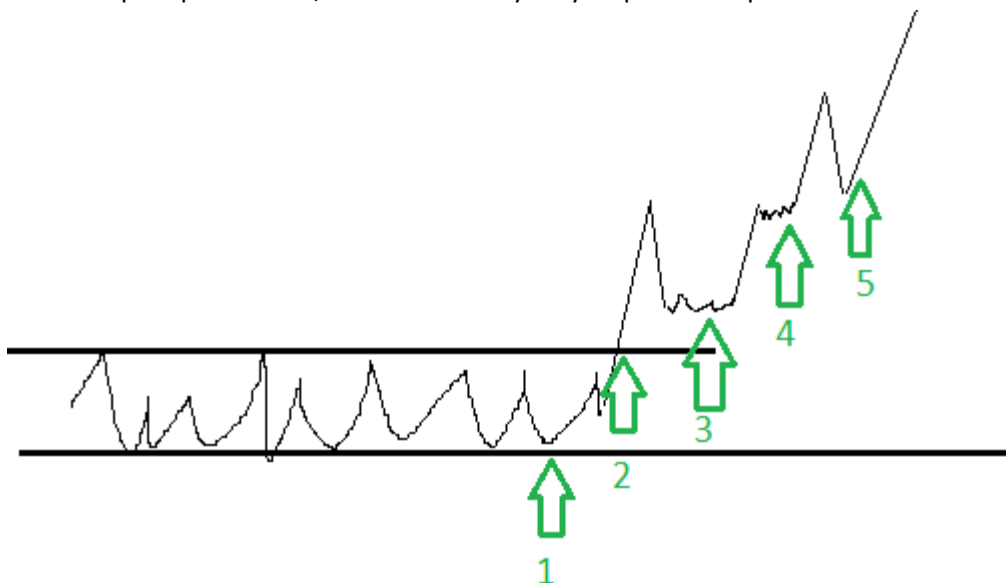




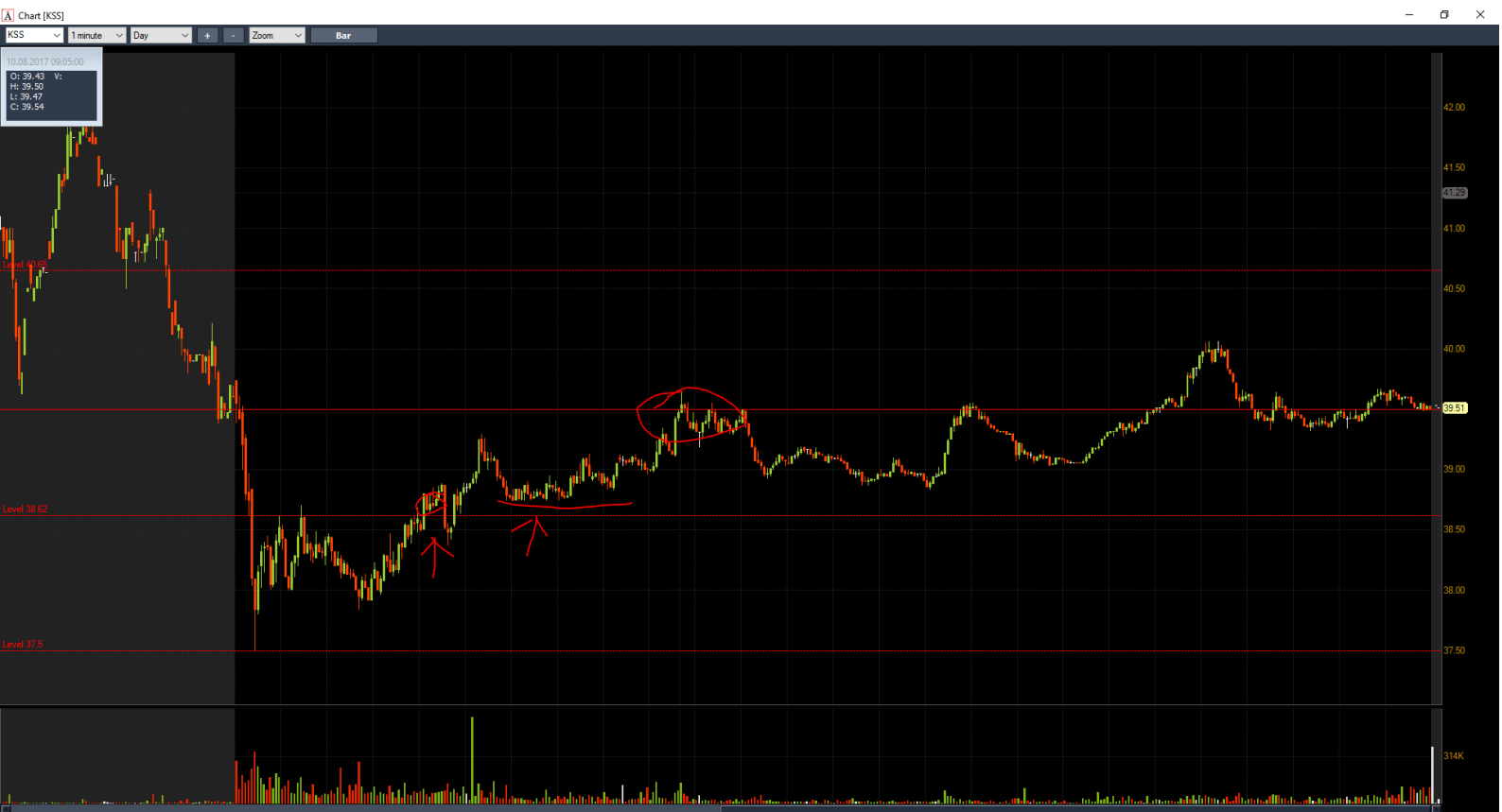
Если утром мне не удалось поймать тренд, я сделаю это позже, когда бумага уйдет из ее консолидации, вернется на уровень (уровень зеркала) +, если он все еще совершает ложный пробой, возвращается и продолжает консолидироваться.

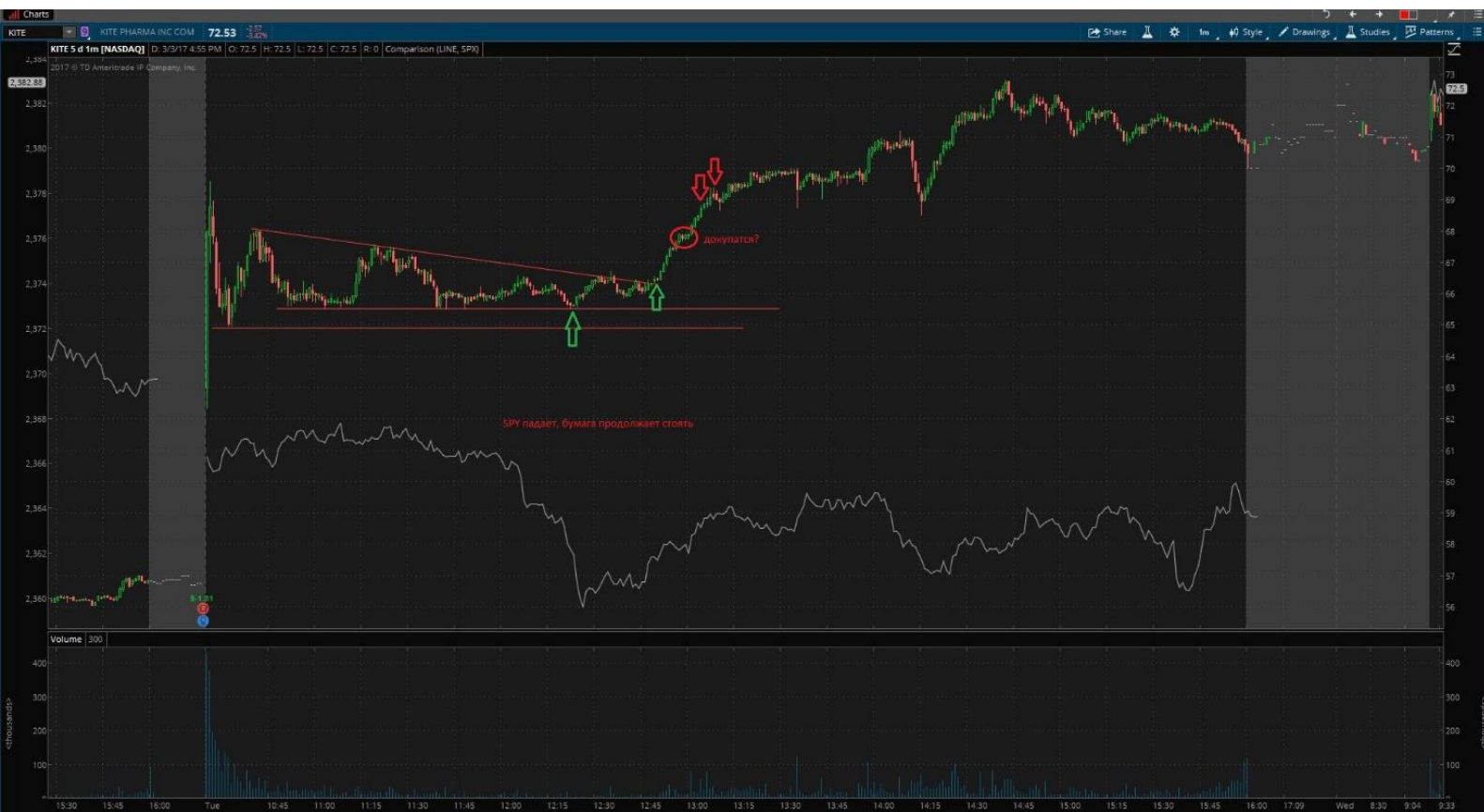
Набор позиции:

- До уровня пробоя. Когда консолидация становится очень узкой, мы наблюдаем за лентой и принимаем решение.
- После пробития, ждем первый откат. Идеально, если сформируется зеркальный уровень. Если после пробития формируется еще одна консолидация и бумага стоит на месте – быть осторожным, нету силы у бумаги для импульса. Смотреть на объем во время пробития и на откате. Проверить level2, неталкает ли бумагу маркет макер.



Имеем 5 точек, где можем набирать позицию. Мне больше всего нравится 3 вариант, не надо долго сидеть и ждать в позиции. На много меньше риск, как в случае 2, потому что во время входа стоп будет ставится по ленте или за low консолидации. Просто ждать входа после пробития





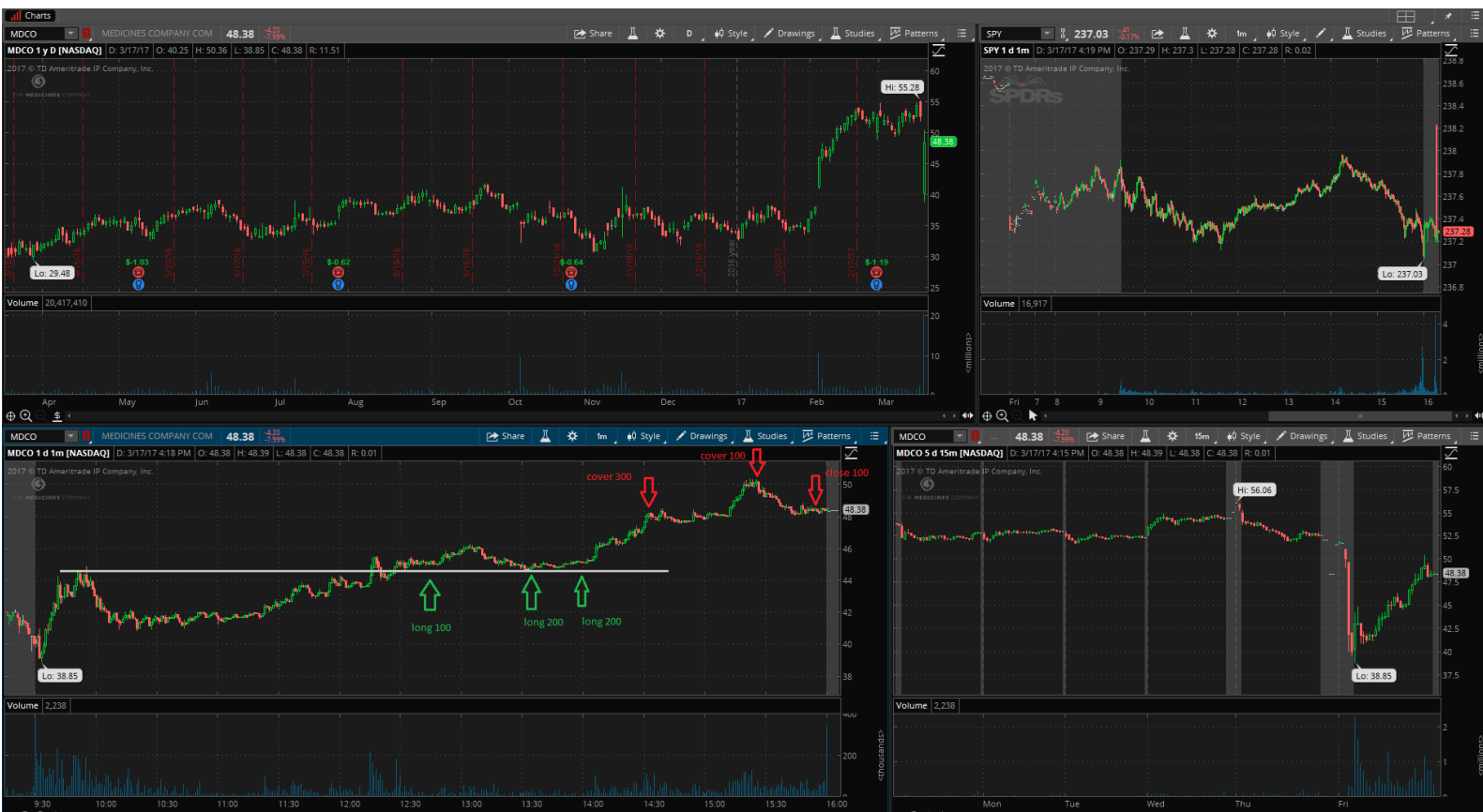
12:00 – 13:00 Обед

В это время нечего надумать, выпить чаю ☺

Часто в такое время я уже заканчиваю работу. Так как ловлю утренние импульсы и тренды которые формируются и утра. Не всегда работа дома выходит высидит всю торговую сессию.

От 13, 14h

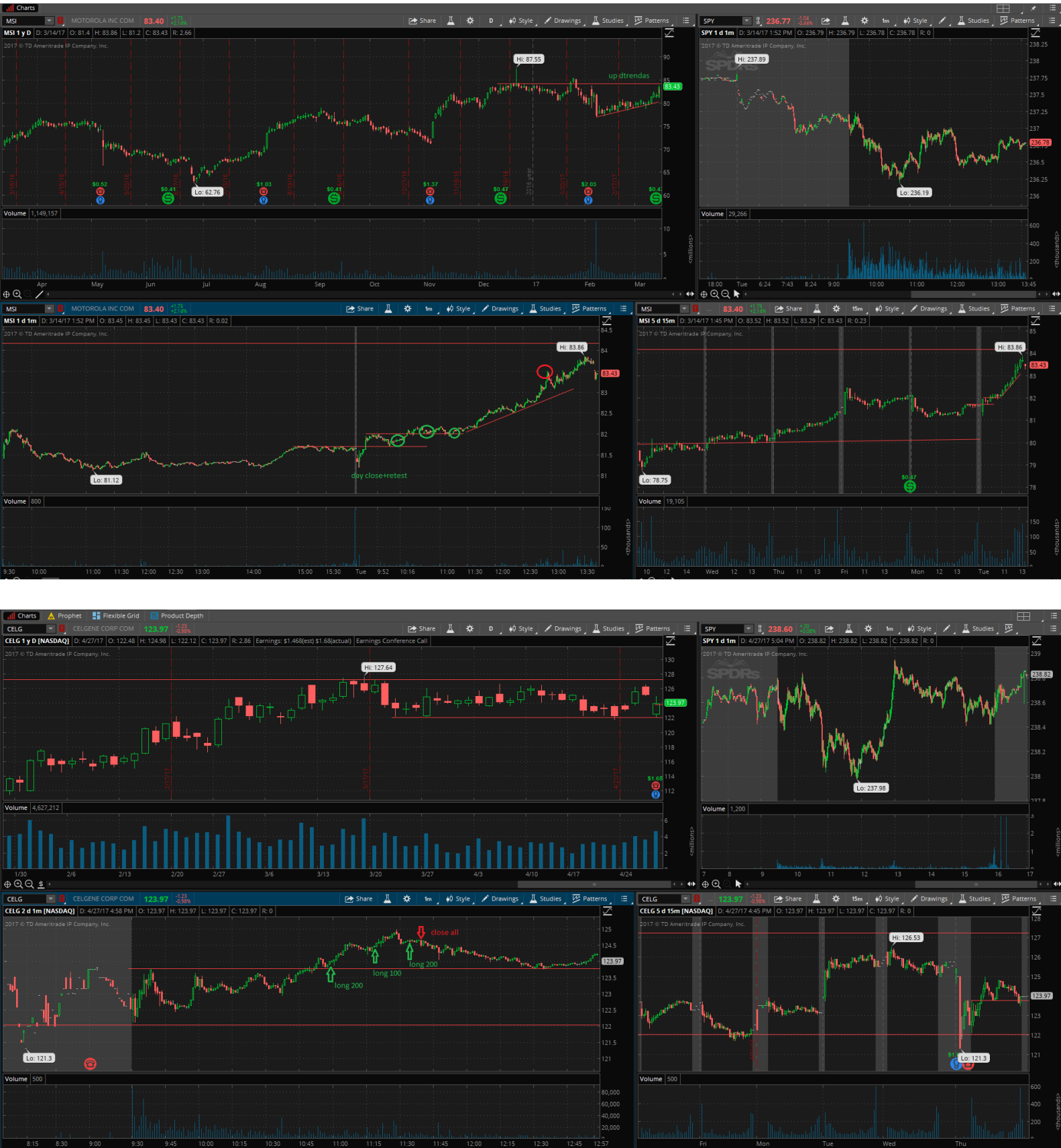
Бумаги которые сегодня сходили 3\$ move+range. Пробивают high/low, делает консолидацию и движется в направлении локального тренда до закрытия рынка. (close move)



High beta

Дорогие бумаги, от 70\$ которые в день ходят 2,5\$ и больше.

Бумаги отбираются по дневным графикам, около критических точек. Или видна, что бумага несколько дней подряд отскакивает от уровня и его не пробивает.



Conference call

Бумаги которые отчитываются сегодня в течении дня, выписать время, когда бывает conference call. И в это время наторговать эти бумаги. Чтобы не было неприятный моментов.

