

Красным выделены фразы, в точности перевода которых я сомневаюсь (прим. переводчика)

Стратегия GENESIS 5_15

Применение Genesis Matrix System на нескольких таймфреймах

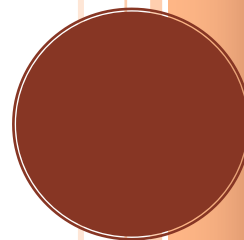
ТРЕЙДИНГ – ЭТО ПРОСТО ВЕРОЯТНОСТНАЯ ИГРА.

Существует случайное распределение между выигрышами и проигрышами для любого заданного набора переменных, которые формируют систему. Другими словами, зная прошлую производительности вашей системы (edge), вы можете сказать, что из следующих 20 сделок 12 будут выигрышными и 8 будут проигрышными. Чего вы не знаете так это последовательность выигрышей и проигрышей и сколько денег рынок даст возможность взять выигравшим трейдерам. Эта истина делает трейдинг вероятностным процессом или игрой чисел. Если вы действительно верите, что трейдинг это просто вероятностная игра, термины типа “правильно” и “неправильно” либо “выигрыш” и “проигрыш” более не имеют для вас того значения, что ранее. В результате, ваши ожидания будут соответствовать вашими возможностями.

“Trading in the Zone”, Mark Douglas

Genesis Team

07/10/2012



Стратегия Генеzis 5_15

Применение Genesis Matrix System на нескольких таймфреймах

ВВЕДЕНИЕ

Этот документ описывает вариант стандартной Genesis Matrix System, которая называется 5_15 Genesis Strategy, мультитаймфреймовая стратегия (MTF), использующая таймфреймы Metatrader 4 M5 и M15.

Основная цель данного документа – сравнение двух разных стратегий выхода с целью максимизации производительности системы.

Представлены два разных правила для входа/выхода и рассчитана их общая прибыльность (производительность).

Это не система для новичков в форекс-трейдинге. Вместо этого лучше посетите babypips/school и пройдите их курс. Он бесплатный и очень эффективный. Вы узнаете оттуда очень много. (Прим. переводчика: Курс на английском языке. Выполнен очень удобно, информация подается доступно, систематизированно и с наглядными примерами)

Стратегия 5_15 предполагает, что вы обладаете базовым опытом технического анализа.

Наша команда считает, что “Случиться может что угодно”. Мы не знаем и не пытаемся предугадать куда будет двигаться рынок.

Перед прочтением данного документа вам следует изучить стандартную стратегию Genesis Matrix и попрактиковаться в ней. (Reference : [Genesis Matrix Trading](#)).

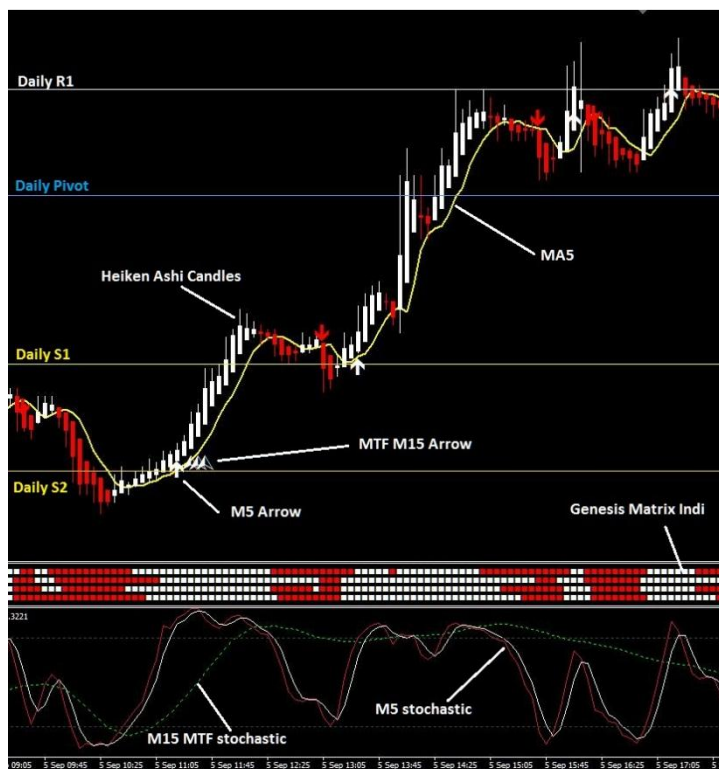
ИНДИКАТОРЫ

Эта стратегия основана на следующих основных индикаторах Genesis:

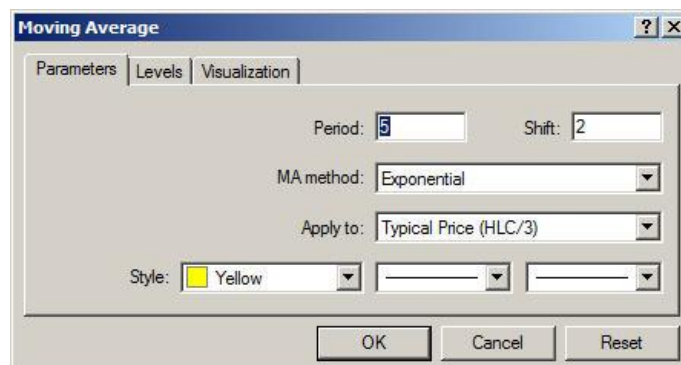
- Genesis Matrix
- Heiken Ashi candles
- EMA 5 (yellow line)
- M5 stochastic
- M15 MTF stochastic
- M5 Arrow
- M15 MTF Arrow

Смотрите ссылки внизу для более подробной информации по этим индикаторам и их настройке:

1. [Genesis Matrix](#)
2. HA candles : [post #3651](#)
3. EMA5 settings : see below
4. M5 stoch settings : [post # 1078](#)
5. M15 stoch settings : [post #3654](#)
6. M5 Arrow : [post #3751](#)
7. M15 MTF Arrow : [post #3335](#)



Настройки ЕМА : Скользящая средняя в Genesis System стандартный индикатор MT4 Moving Average со следующими свойствами:



Взято из [post 4403](#): В настройках скользящей средней (moving average) вы можете установить сдвиг, выставив 2 вы сдвинете скользящую среднюю вперед на 2 свечи, основная цель сдвига – попытка стать ведущим (основным).

Дополнительные индикаторы:

Уровни Pivot могут помочь отследить важные уровни, в частности во внутридневной торговле, так как цена может остановиться либо развернуться на этих уровнях. Избегайте покупок ниже Daily Pivot и продаж выше Daily Pivot. Уровни Pivot также являются отличными целями для Take Profit.

КОМБИНАЦИИ (СЭТАПЫ)

Сэтапы нужны для того, чтобы дожидаться и видеть наличие правильных условий чтобы делать самые прибыльные сделки.

Genesis Matrix – это отличный комбинированный индикатор, но это не просто зеленый/красный сигнальный флажок, который говорит когда открывать/закрывать позицию и делать деньги. Чтобы извлечь из него пользу, вам нужно интегрировать его в торговую систему, которая дает вам положительное ожидание и соответствующим вашим предпочтениям.

Как уже было сказано, Genesis Matrix – это комбинация 4х индикаторов. Комбинация улучшает и дополняет сигналы отдельных индикаторов и дает вам большую частоту удачных входов в рынок.

“Случиться может что угодно” и мы не можем и не пытаемся предугадать куда пойдет цена... Но мы можем планировать нашу торговлю!

Как и многие индикаторы его сигналы можно отнести к отстающим (lagging) ([leading-vs-lagging](#)) в сравнении с обычным движением цены, в частности когда движения цены неожиданны. Все индикаторы отстают... нет индикатора, который бы предсказывал куда цена двинется дальше. То есть отставание, которое может наблюдаться в Genesis Matrix, минимально и не причиняют серьезных проблем.

Поэтому, если вы собираетесь использовать стандартный Genesis или стратегию 5_15, важно, чтобы цена могла пройти достаточно пипсов в вашем направлении.

Потому, что мы не знаем что случится и случиться может все, что угодно... Как же нам выбрать нужный момент?

Ниже представлены некоторые указания чтобы брать высокоприбыльные сделки:

- ✓ Фильтрация по времени : выбирайте время в течение дня, когда волатильность выше (обычно от открытия Франкфуртской/Лондонской биржи до второй половины Нью-Йоркской сессии). Уделяйте внимание открытию Франкфуртской биржи, т.к движение цены отменяется (movement is denied) открытием Лондонской биржи (reference : [post # 4142](#))
- ✓ Торгуйте по тренду: Это очевидно и вы слышали это тысячи раз: “тренд ваш друг, пока он не окончился”. Хорошо, но как же определить его окончание? Вот некоторые предложения:
 - Попробуйте использовать скользящую среднюю на старшем ТФ и следите за следующими условиями чтобы распознать потенциально заканчивающийся тренд:
 1. Положение цены (под/над МА)
 2. Направление МА (возрастающая или спадающая)
 3. Наклон МА (Моментум Тренда)
 - Стохастический осциллятор. Еще раз старший ТФ даст вам направление, когда младший ТФ помогает вам выявить лучшую точку входа. Это причина, по которой некоторые из нас используют стохастик М15 в том же окне вместе со стандартным... это наш компас. Не пытайтесь ловить идеальные разворотные точки, подождите явного тренда на старшем ТФ перед выбором направления... другими словами, подождите пересечения стохастика в вашем основном ТФ и подъема с уровня 20/30 или падение с уровня 80/70 в соответствии с направлением стохастика на старшем ТФ.
- ✓ Уровни Поддержки/Сопротивления(S/R): Это базовое знание должно у вас быть до того, как вы начнете торговать. Если цена приближается к уровню S/R будьте внимательны потому что все мы пытаемся понять что произойдет... “Покупайте рядом с уровнем сопротивления и продавайте возле уровня поддержки” особенно после хорошего сигнала на основном таймфрейме или подтверждения (двойная вершина(дно) или паттерн 123). Для торгующих внутри дня уровни pivot играют важную роль, если цена над дневным уровнем pivot ищите возможности для покупки и наоборот ([Support/Resistance](#)); это правило не работает во время консолидации, когда дневной pivot может быть пробит несколько раз.

ПРАВИЛА ВХОДА

Когда сэтап хороший и какие сигналы на вход?

ВХОД1: Standard Genesis LONG/SHORT rule (reference : post #2)

- 1) 4 точки матрицы приобретают один цвет после закрытия текущего бара.
- 2) стохастик М5 пересекается (crossover) и выходит из уровней перекупл-ти/перепрод-ти 20-80.
- 3) бар НА открывается выше/ниже ЕМА5.

Стрелка(Arrow) M5 сейчас мы не всегда ждем стрелки, т.к. при неожиданных движениях цены она может запоздать... но... если стрелка M5 не появляется на следующей паре баров, мы внимательно наблюдаем за сделкой из-за возможного раннего выхода.

ВХОД 2 : 5_15 Genesis LONG/SHORT rule

Этот вход такой же как стандартный, но мы использует стрелку

M15 как фильтр и входим в рынок только в направлении M15 arrow . **Как вы можете увидеть из приведенной статистики это увеличивает доходность системы при использовании другой стратегии выхода.** (As you can see from the following statistics, this increases the return of the system using either exit strategy.)

ПРАВИЛА ВЫХОДА

Это самая сложная часть любой системы и требует и опыта в техническом анализе и психологической устойчивости. Мы стараемся определить как можно больше механических правил чтобы помочь решению трейдеров. При некоторых рыночных условиях (рендж), нет большой разницы между тремя стратегиями выхода; но в других ситуациях (тренд), разница между тремя стратегиями выхода показывает впечатляющую разницу, **частично применяя тактику масштабирования.** (particularly adopting a scale-in tactic). Очевидно, здесь есть другая сторона медали; психологически нелегко смотреть как цена двигается против вас и ждать.

Существует три сценария выхода из позиции: потеря(loss), прибыль(profit) и прерывание (breakeven)

ВЫХОД ПО СТОП-ЛОССУ

Смотрите раздел Риск и Мани-Менеджмент.

ВЫХОД ПО ТЕЙК-ПРОФИТУ

Если цена двигается в направлении вашей сделки, рано или поздно вам нужно будет принять решение закрыть вашу позицию, частично или полностью; здесь у нас есть 3 варианта.

ВЫХОД 1 : Выход по уровням Pivot & поддержки/сопротивления

Когда наблюдается сильное движение цены в определенном направлении, она не останавливается произвольно... она останавливается на уровнях поддержки/сопротивления. Чаще всего это предыдущий исторический максимум или минимум, круглое число или уровень Pivot . Уровни Фибо тоже считаются, но их лучше применять в долгосрочной торговле, но не внутри дня.

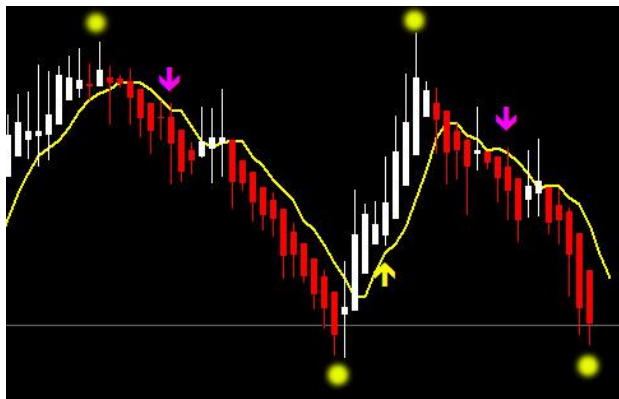
Типичный выход

Здесь мы видим, что цена покинула дневной pivot. Очевидная цель – следующий ближайший уровень сопротивления, которым в этом случае является уровень S1 pivot. Когда цена достигла этого уровня был выполнен выход. Вы можете видеть, что здесь был элемент ‘проскальзывания’ когда цена достигла уровня S1. Иногда цена останавливается точно на линии, иногда нет.

Как мы видим, был разворот цены и выход из позиции (это было видно на стохастике, которого нет на рисунке).



Иногда цена будет зависеть на этом уровне перед продолжением движения, что дает возможность повторного входа в сделку если был произведен выход на уровне S1 или (если предыдущая позиция еще открыта) войти в новую сделку с целью увеличения прибыли. В этом случае следующей целью будет уровень S2. Круглые числа работают схожим образомчисла типа 1.2800, 1.2900, 1.3000, также могут выступать уровнями High/Low как видно из рисунка.



ВЫХОД 2 : Scalper exit

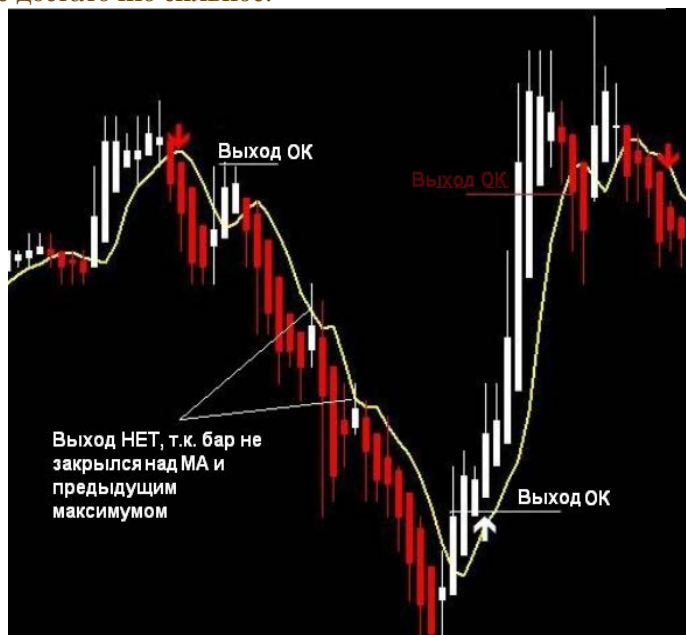
Вот идея по взятию быстрого профита после импульсов, следуя за основным движением. (Here, the idea is to take quick profits after the impulse due to the momentum) После выхода будьте готовы к новой возможности входа при развороте либо в том же направлении при продолжении тренда, в соответствии с правилами входа Genesis и если движение достаточно сильное.

Выход из покупки :

Первая противоположная свеча, которая закрылась ниже ЕМА5 и уровня Low предыдущих 1-2 баров.

Выход из продажи :

Первая противоположная свеча, которая закрылась выше ЕМА5 и уровня High предыдущих 1-2 баров.



ВЫХОД 3 : Swinger exit.

Здесь представлена идея, которая заключается в том, чтобы дать движению цены (Price Action) развиваться и пройти как можно больше. Концепция такова: мы предпочитаем входить как scalper и выходить как swinger, в соответствии с сигналами, идущими с ТФ М15, но при этом наблюдать за действиями цены на М5.

Существует 3 основных выхода по этой Стратегии:

:

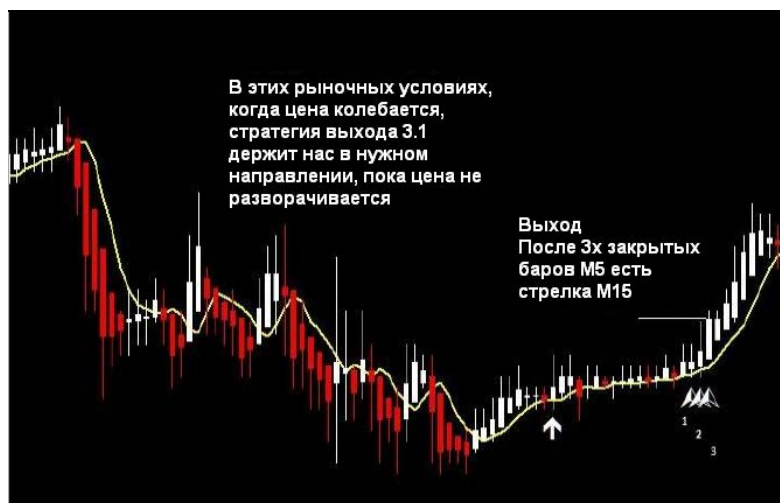
Выход 3.1 : M15 MTF Arrow Signal

Выход из покупки:

После 3х баров на М5, на которых рисуются стрелки MTF вниз

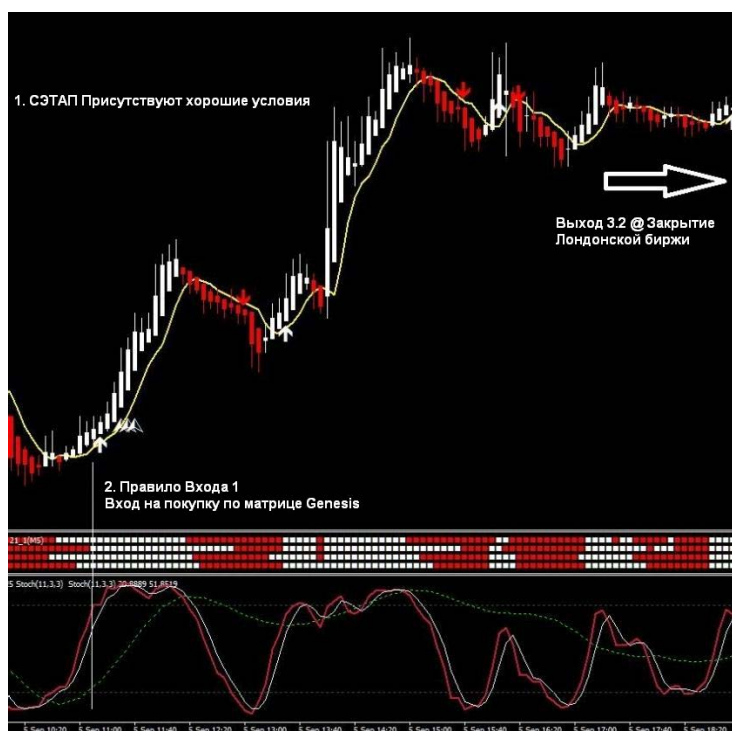
Выход из продажи:

После 3х баров на М5, на которых рисуются стрелки MTF вверх



Выход 3.2 : По закрытию Лондонской биржи (Time Filter)

В конце Европейской сессии рынок обычно становится вялым и волатильность падает, поэтому мы забираем нашу прибыль, независимо от того как ведет себя цена.

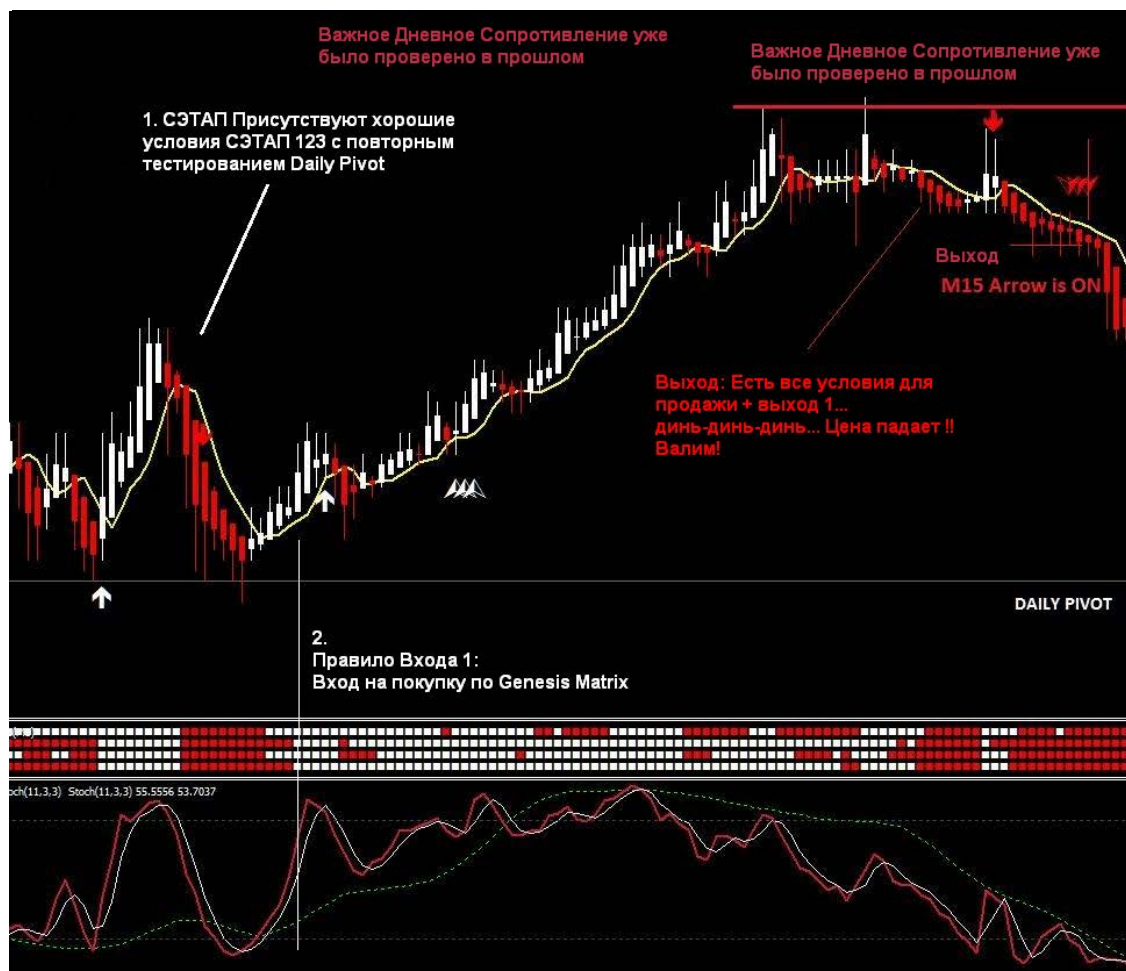


Выход 3.3 : Обратный сигнал на вход1 на М5

При неожиданном развороте цены, стрелки М5 и М15 могут опоздать. Поэтому, если попадаетесь хороший сэтап в противоположном направлении и все условия из Вход 1 присутствуют, рынок говорит вам: “Эй, народ, я разворачиваюсь!!!”... в этом случае не ждите стрелки М15, а закройте позицию и войдите в противоположном направлении или подождите.

Это случается обычно перед некоторыми важными новостями или рядом с сильным уровнем поддержки/сопротивления или пивотом в контртрендовом направлении, иногда (но не всегда) после повторного теста зоны и как раз в это время начинает появляться первый из трех M15 MTF Arrow символов.

В этом случае опыт трейдера играет важную роль. Предложение по защите торгов от этих событий без потери возможностей поймать потенциальные пробои - это перенести ваш СЛ к пробой или близко к опасной зоне и ждать.



РИСК и ТРЕЙД МЕНЕДЖМЕНТ

В этом разделе мы рассмотрим менеджмент стоп-лоссов. В каждой торговой системе случаются черные полосы и мы не знаем когда это случится и сколько это продлится. Единственная вещь, которую мы можем контролировать – это то, что мы делаем и как мы защищаем наш капитал.

Размер позиции

Размер позиции – очень важная часть трейдинга как минимум по двум причинам: неправильный размер позиции может нанести вред (перегрузка депозита, overleveraging); вторая причина – правильный размер позиции может увеличивать вашу прибыль. Не существует “золотого правила”, так как очень многое зависит от отношения трейдера к потерям и рискам, доверию системе, вере в себя, а также внутреннему психологическому состоянию...

Наш совет – решите сколько вы готовы потерять в случае неудачи (% вашего рискованного капитала) и затем перевести их в микро-, нано- или обычные лоты и заодно в пипсы. Это максимальное количество пипсов, которым вы можете рисковать в одной сделке.

Так как СЛ определяет каким количеством денег вы рискуете в сделке, можно рассчитать лот по формуле:

$$\text{Lots} = \left(\left(\frac{\text{ПроцентРискаНаСделку}}{100.0} \right) * \text{СвободныеСредства} \right) / \left(\frac{\text{ЦенаПипса}}{\text{СЛвПипсах}} \right)$$

The PipValue, above, is the USD dollar value of 1 pip move for a full lot trade. So, for GbpUsd or EurUsd, it is 10. For a Yen pair, it is 1000/UsdJpy ask price(ниасилил, т.к не пойму о чем речь:)

Начинающим трейдерам стоит выбрать фиксированный маленький лот, который будет использоваться, пока не будет достигнута продолжительная прибыльность в работе с системой и уже после этого переходить к расчету больших величин лота.

Стоп Лосс

По этой стратегии мы всегда используем СЛ и размещаем его в соответствии со стандартными правилами (ref. : [post # 2 : SL](#)):

СЛ для продаж размещаем выше предыдущего локального максимума+спред, для покупок – ниже минимума+спред. Должны сказать, что СЛ размещается не для того, чтобы вы сидели и ждали, пока цена коснется его при развороте. Это аварийная защита. Смысл в том, что если вы определили разворот цены, то вы вручную выходите из позиции и входите в противоположном направлении. Ложной экономией является размещение СЛ, скажем, в 10 пипсах от точки входа вместо размещения выше/ниже недавнего максимума/минимума.

Это может выглядеть более дешевым условием, но когда раз за разом выбивает ваш СЛ и потом движется в направлении индикаторов Genesis такой подход может обойтись очень дорого. Цене нужно пространство для “дыхания”... Цена не движется по прямой линии. Между прочим, если ваш СЛ, расположенный выше/ниже недавнего максимума/минимума выбивает ценой, то можете быть уверены, что цена разворачивается, а не просто “дышит”.

“The only thing we can control it is what we do”

Прерывание(Break Even) и Trailing Stop

СЛ это как аварийная защита, вы не должны обязательно сидеть и ждать его срабатывания.

Если мы не закрыли позицию по одному из двух правил выхода и профит превысил 20 пипсов, мы переносим СЛ в безубыток чтобы иметь в руках безубыточную сделку и ждем закрытия позиции согласно 1му либо 2му правилу выхода или открываем новый ордер по следующему сигналу матрицы. В таком случае СЛ переносится на новый уровень, чтобы защитить 1ю сделку и рисковать деньгами рынка в новой сделке.

ДОХОДНОСТЬ (ПРОИЗВОДИТЕЛЬНОСТЬ)

Статистика прибыльности системы представлена только для пары EUR/USD. Тесты проводились с 13 августа 2012 по 7 сентября 2012 когда наблюдались очень разнообразные рыночные условия (от небольших колебаний до сильного тренда)

В собранных и проанализированных ниже данных применялись только Правила Выхода 2 и 3.

Протокол тестирования

Как только появлялись условия, удовлетворяющие Стандартным Правилам Входа Genesis Matrix, мы открывали сделки. Мы закрывали сделки, согласно Правилам 2 и 3, затем рассматривали наличие следующих условий: наличие/отсутствие стрелки на М5, бары перед появлением стрелки М5, наличие/отсутствие стрелки М15, бары перед появлением стрелки М15, направление торговли, Цена Открытия, СЛ, цена выхода по Правилу 2, соотношение Риск/Прибыль при выходе по Правилу 2, соотношение Прибыль/Потери при выходе по Правилу 2, Цена Выхода по правилу 3, Соотношение Риск/Прибыль при выходе по Правилу 3, соотношение Прибыль/Потери при выходе по Правилу 3.

Полученные результаты представлены в таблице ниже.

Overall 5_15 System	Exit 2	Exit 3
Total Number of Trades	53	53
Total net profit (pips)	+907	+1806
Gross Profit (pips)	+950	+1881
Gross Loss (pips)	-43	-75
Number of winning trades	34	38
Number of losing trades	19	15
Percent Profitable	64.1%	71.7%
Largest winning trade (pips)	+58	+143
Largest losing trade (pips)	-11	-19
Avg. winning trade (pips)	+27	+50
Avg. losing trade (pips)	-5	-8
Avg. Risk/Reward	1.24	2.43

Обозначения:

Total net profit	(Gross Profit – Gross Loss) в пипсах
Gross Profit :	Полученные пипсы
Gross Loss :	Потерянные пипсы
Winning trades :	Поскольку мы прерывали некоторые сделки, то чтобы получить более реальную статистику мы определим выигрышную сделку как сделку с профитом > 10 пипсов
Losing trades :	И наоборот, проигрышная сделка - сделка с профитом <= 10 пипсов
Percent Profitable :	Выигрышные сделки/Общее количество сделок. Это важно чтобы рассчитать количество денег, которыми вы собираетесь рисковать, чтобы увеличить возврат (return) от системы
Largest winning trade :	Наибольшее количество полученных пипсов
Largest losing trade :	Наибольшее количество потерянных пипсов
Avg. winning trade :	Среднее количество полученных пунктов за выигрыш
Avg. losing trade :	Среднее количество потерянных пунктов за проигрыш
Avg. Risk/Reward	Среднее количество полученных пипсов / средний СЛ в пипсах

База данных вызывает некоторые последующие вопросы.

1. ЗАВИСИМОСТЬ ПОЛУЧЕННЫХ ПИПСОВ ОТ КОМБИНАЦИЙ СТРЕЛОК

Как влияет наличие/отсутствие стрелки М5 и М15 во время входа на результаты сделки?

EXIT 2			
	M5 Arrow NO	M5 Arrow YES	Total pips
MTF 15 Arrow NO	123	103	226
MTF 15 Arrow YES	217	464	681
Total pips	340	567	907
EXIT 3			
	M5 Arrow NO	M5 Arrow YES	Total pips
MTF 15 Arrow NO	202	358	560
MTF 15 Arrow YES	231	1047	1278
Total pips	433	1405	1838

The total amount of pips is different than overall 5_15 stats because the winning trade definition.

2. ЗАВИСИМОСТЬ КОЛИЧЕСТВА СДЕЛОК ОТ КОМБИНАЦИЙ СТРЕЛОК

Trades			
	M5 Arrow NO	M5 Arrow YES	Total trades
MTF 15 Arrow NO	8	10	18
MTF 15 Arrow YES	8	27	35
Total trades	16	37	53

3. ЗАДЕРЖКА БАРОВ СО СТРЕЛКОЙ

Сколько в среднем баров М5 нам нужно ждать после получения сигнала от матрицы, перед тем как появится стрелка?

	M5 ARROW	M15 ARROW
Number of M5 bars	3.1	11.5

ВЫВОДЫ :

1. Доходность Genesis Matrix Trading System потенциально может быть улучшена применением Стрелок на М5 и М15 как компонентов для определения сигнала на вход; 73% точность для выхода по Правилу 2, 80% точность для выхода по Правилу 3.
2. Стрелки MTF дают значительно лучше сигналы для выхода, чем закрытие над/под индикатором МА5, как в отношении процента прибыльных сделок, так и в отношении количества полученных пипсов; улучшение на 39% при “Входе без стрелок (по сигналу матрицы)” и до 55% при “Входе с обеими стрелками”.