

1. Obchodovanie ceny s nahradením stopov hedžingom pre limitovaný a nižší risk
2. Správové minimum, ako využiť silu očakávania, jednoduché vyhodnotenie správ v real čase

Tento material upravuje postupy obchodovania a zavádza pravidlá ak obchoduješ cenu a stopy nahrádzaš hedžingom podľa definovaných pravidiel.

Ak hedžuješ podľa pravidiel nejde o obchodovanie bez stop lossu, lebo výška tvojich strát je obmedzená limitovaná hedžingom, ktorý ti nahrádza stop.

-hedžingový štýl + obchodovanie ceny prináša úsporu na stopoch obchoduješ ako keby 2-7 dnovú opciu no zároveň tvoje obchodovanie ostáva jednoduché a straty obmedzené s vyšším potencionálom profitu, lebo stopy ťa o profity oberajú tým, že bežná volatilita dní ti ich poberie no z dlhodobiejšieho hladiska by tvoje obchody boli napr. inak úspešné - poznáme to všetci trh pobral stopy a následne spravil napr 100 bodov bez nás - tento štýl obchodovania toto rieši

Upozornenie / Výstraha

Ak by si obchodoval bez stopov a súčasne bez hedžingu, tvoj účet nemá šancu dlhodobo prežiť (priemerná životnosť účtu pri tomto štýle bez hedžingu je 6 mesiacov) pretože určite nastane jedna s týchto dvoch situácií:

1. Príde ročná cunami vlna, ktorá ťa v periode dní môže pripraviť o 50-100 % účtu, čiže zisky ktoré si dlho zbieral o ne rýchlo prídeš, ak pri 2000 e účte máš otvorených viac ako 0,30 lotu naraz spolu pred cunami nie je potom účet chránený.
2. Straty na účte sa naakumulujú postupne tak, že presiahnu 50 % tvojho účtu a následne položia účet tieto kumulované straty ak nehedžuješ prípadne + k tomu menšia cunami vlna to dokončí

Ak však pravidlá hedžu pri tomto štýle tradingu pre jednu pozíciu aj celý účet dodržíš a obchoduješ cenu, tvoj účet dlhodobo týmto štýlom prežiť môže, zároveň ušetríš na stopoch ktorá ti nepoberie denná volatilita.

čiže tento štýl je v podstate štýl opčný štýl ceny, že obchoduješ cenu hlavne na 2-7 dní, Ak je perioda dlhšia ako 7 dní riziko stúpa, preto 90 % obchodov ak sa dá treba ukončiť do 7-10 dní, s tradingom je to ako s počasím predpovede sú najlepšie na 3 dni a 7-10 dní, dôvod je aj ten, že na týžden vopred máme predpovede správ stĺpec v tabulke forecast, čiže je vhodné si zmapovať týžden s pohľadu červených správ pre napr. gold a silver aby ste vedeli koľko dní v danom týždni je podľa očakávaní selových a koľko longových a čo prevažuje. Keď viete ake ingrediencie tam pravdepodobne budú viete lepšie čo sa koľko sa s toho bude dať navariť a s akým cca rizikom, či sú dvojité šance a kedy. Jednoducho správový mapping očakávaní týždňa.

Trh na 70 % chodí podľa očakávaní. Ak ja napr. mám 2 x šancu na očakávania červených správ, tak robím vyššie množstvá ako bežné, tj. ak je dvojitá šanca, tak dvojité množstvo asi tak samozrejme uplatnujem princíp po tretinách.

- Ak napr. boli očakávania na červené správy longové a čísla vyšli pre gold silver selové a trh
3. zahájil sell trend, nastúpim do vyššieho objemu množstva vtedy, ak na ďalší den sú forecast očakávania pre gold silver selové, čiže ak by to nevyšlo dnes a trh by sa náhle otočil mám šancu, že obchod bude v zisku do zajtra čo je z pohľadu risku dobré.
 - 4.

Je dôležité mať aspon 30 -50 % pozíciu stopov posunutých v zisku, ak by sa správa na ďalší den nepotvrдила v smere očakávaní, aby sme zobrali aspon napr. polovicu.

5. Efekt očakávaní je veľmi silný je to podobné ako za socializmu keď mali dostať pomaranče v obchode babky niektoré očakávali pred obchodom už od rána, čiže tvoril sa očakávaný rad a trend v smere očakávaní.

Ak poobede nedoviezli babky sa rozprchli a trend sa zmenil babky začali chodiť preč od obchodu, tento efekt funguje aj na trhoch

pravidelne a konzistentne a poskytuje vám výhodu, ktorá je tu pre vás.

V tradingu "ak poobede nedovezú" a máte stopy v zisku už z prvého dna vaša výhoda a zisk :)

Ak nerozumiete správam:

Porozumenie očakávaniam pre USD

Akákoľvek production gdp, výroba je lepšie ak sú predpovedné čísla lepšie ako minulé v tj. stlpci previous

čiže treba si položiť otázku znamená toto očakávané číslo zlepšenie pre ekonomiku usd ?

Ak ide o napr nezamestnanosť je jasné že zlepšenie je vtedy ak sú očakávané čísla nižšie

A TERAZ k výjdeným číslam na forexfactory ak vyšli nové čísla napísané čiernym ingustom je to neutrálne vyšlo to isté čo sa čakalo pohyb preto bude obvykle menší.

Ak výjdu čísla zeleným atramentom potom čísla boli pre Usd lepšie, ak usd stúpa zlato obvykle klesá

Ak výjdu čísla červeným atramentom potom je to horšie pre ekonomiku Usd, dolar obvykle klesá a zlato stúpa

Ak výjdu naraz 2 červené správy a jedna červené čísla a druhá zelené potom je lepšie do takého trhu nevstupovať alebo si počkať aspon 10 min. No je tu riziko otočenia trendu vysoké

6. Ak v danom dni sú 2 červené správy pre usd trh si obvykle počká na 2. z nich a až potom definitívne naberie konkrétny trend.

Poznámka snažil som sa napísať jednoduché správové minimum, ktoré by mohlo byť užitočné, bez toho aby ste museli zložito študovať čo každá správa presne znamená

ide predsa o výsledok a čo to nakoniec obvykle pravdepodobne urobí a o to ide.

Trhy sa podľa čísel tj logicky chovajú v 70 % prípadov tj. to isté ako v prípade očakávaní.

Dnes napr. Je piatok o 1430 vyšli červené správy horšie pre usd, ďalšie správy červené

lepšie pre usd mali výjst podľa očakávaní o 16 tej. O 1430 som neotvoril lebo trh o 16

tej čaká podľa očakávaní protichodnú správu, obvykle trh jasne trenduje až po 2. červenej čo je konzervatívny vstup ak obchodujete na správy tj po 2. červenej.

Počkal som si na 16 hodinu, čísla pre usd vyšli červené tj horšie pre usd a nie lepšie ako sa čakalo, čiže o 1430 aj 16 vyšli horšie čísla pre usd, čo je horšie pre usd a lepšie čiže long pre usd, overujem si teda či sa trh zachová logicky a pozorujem po správe o 16 tej inikátory bulls/býci a medvede bears. Bears 45/Bulls 10 v prospech medvedov aj 15 min po správe.

Trh sa nezachoval logicky, vyšli iné dáta ako sa čakalo a tak sa to zaseklo, najlepšie v tejto situácii istý zisk je to nevstupovať za takýchto okolností do trhu. To je teraz môj zisk.

Momentum na sliveri je teraz presne na stredovej 100 línii po starom je to stredová 0 lína podľa vt na golde to isté, takmer dokonalý pat a trh bez trendu. o patový trh bez trendu nemám záujem.

A navyše je piatok po 16 tej obchodný týždeň som preto ukončil. dnes je 28.2.2014 krátko po 16 tej.

Diagnostika trhu pred vstupom: Trend rejting/Hodnotenie trendu

7.

8. Ako typ trhu ovplyvňuje zvyšuje/znižuje úspešnosť vašej stratégie :

1.A Dynamický silný trend Pravdepodobnosť úspechu 90 %(prieraz suport rezist silné momentum) napr. 2,5 a viac násobná prevaha bulls/berars podľa indikátora.

Ak máte súčasne aj podľa očakávaní správ aj "dvojitú šancu" na ďalší den podľa červených správ v takomto trhu je odúvodnené otvoriť maximálne množstvo pozície,ktoré obchodujete napr. 0,05 pri 2000 účte.

1B Dynamický stredný trend Pravdepodobnosť úspechu 85 %
1 C Trend priemerný Pravdepodobnosť úspechu 70 %

2 A Trend ktorého dynamika dosiahla už svoj zenit vrchol Pravdepodobnosť úspechu 60 %
2 B slabnúci spomalujúci trend cca od 18-20 pre gold silver Pravdepodobnosť úspechu 60 %
3. C Trh bez tredu "skapatá ryba" momentum okolo 0,oscilačný Pravdepodobnosť úspechu 5%

Ak obchodujete čisto na správy diagnostika trhu je veľmi dôležitá,ak obchodujete cenu podľa typu dynamiky trhu zvyšujete / znižujete position sizing,množstvá ako jeden s faktorov position size,alebo podľa dynamiky trhu uskutočňujete prípadný/dokup/ výstup ako jeden s faktorov.

Ak obchodujete cenu pri vstupnej cene nemusí byť trh dynamický,no ak taký napr. po správe alebo v danej chvíli je,môžete na základe zisteného správania trhu a faktu správy dokupovať ďalšie pozície v smere dynamiky trhu/trendu.

9. Očakávania správ pre ďalší týžden na forexfactory sú pridané obvykle piatok poobede na next week ďalší týžden,takže si môžete zmapovať v piatok poobede trh na ďalší týžden a prispôsobiť tomu vaše aktuálne obchody podľa toho ktoré dni long/sell podľa očakávaní prevažujú

Koniec jednoduchého správového minima

Poznámky a vysvetlenia k postupom obchodovania ceny kde stop je nahradený hedžom podľa pravidiel

na riadených sme prešli na obchodovanie bez stopov má to však tieto pravidlá ak ide o dlhodobejšie obchody tj viac ako na 2 dni planované tak množstvá 0,01 najcastejšie robime vynimocne 0,02
[9:09:42] Trader Robo: - ak ide o obchody krátkodobé 1-2 dni tam sú možstvá 0,01 až 0,05
[9:11:53] Trader Robo: 0,05 iba vtedy aký ide o dvojitú šancu,tj ak sú očakávania na červené správy 2 dni posebe v našom smere,alebo aj vyjdu čísla na spravy v našom smere a na ďalší den su očakávané na červené v rovnakom našom smere čiže ak sú šancie vyššie 2 nasobne ideme do vyššieho rizika no iba kratkodobo obvykle 1-3 dni
[9:12:41] Trader Robo: - obchodujeme cenu,no ak ide trh proti nám tak ak:

1. jednotlivá pozícia alebo celý účet urobia vyššiu otvorenú stratu jako closnutý zisk na celom účte,alebo ako closnutý zisk zobraňný za posledný mesiac potom sme prijali robiť hedžing takýchto obchodov ak trh ide proti nám a sú splnené tieto podmienky. Hedžing ukončujeme ak trh dokončí formáciu, tj vytvorí dno vrcho

[9:16:45] Trader Robo: no keby tam nebol hedžing, tak by účet dlhodobo neprežil pretože straty by sa naakumulovali a z dlhodobého hladiska by to účet položilo

[9:17:42] Trader Robo: urobili sme chybu,že sme to na jednom novom účte nezahežovali teraz keď bola tá longová cunami na striebre ktore skočilo o + 7 % za 2-3 dni vieš

[9:18:21] Trader Robo: čiže ak nemáme stopy je potrebné limitovať stratu inak a to hedžingom,ktorý nahradí stopy

[9:19:38] Trader Robo: získa sa tým výhoda,že volatilita nepoberie stopy, no zároveň ak trh pojde proti nám, tak výška straty bude hedžingom obmedzená stopl loss máme teda v pravidle povinného hedžingu za presne definovaných podmienok

[9:21:33] Trader Robo: čiže riziko je obmedzené a to je podstatné, nie je podstatné či stopmi alebo hedžom podstatné je, že je obmedzené a že hedž máme ako už povinné pravidlo namiesto stopov, ak by nebol hedž boli by povinné stopy

je to priateľný kompromis a tak sme prijali hedžové pravidlá, ak obchodník obchoduje hlavne cenu a bez stopov tak pri napr selli by mal predávať na vrchole trendu, ak napr v priemere berie obchodník na danom obchode 0,01 20 zisk tak je povinnosť ak by mal otvorenú pozíciu -40 na tej 0,01 urobiť hedžing v opačnom smere a ukončiť ho ak je dokončená technická formácia dno alebo vrchol, formácia vrchol je dokončená napr ak horné rezistencie 2-3 sú nižšie ako pôvodne, ak sa vytvorí na eme 12 rovinka a momentum sa dotkne stredovej línie nanesej úrovne 100

[9:27:01] študent: hedžol som to zase ale nižšie než predtým takže som zväčšil stratu

[9:28:53] študent: nakoniec som zistil že dlhodobý trend je už pass po týždni a že to ide stále rúpať mne a skončil som to a odpísal tie straty ktoré boli limitované hedžom ale aj tak ma to len držalo stále v napätí a v strehu čo sa tam deje hedžovať nehedžovať kedy skončiť hedž pojde to ďalej nepodje a tak a vytracala sa mi pohoda z toho

[9:30:05] Trader Robo: no ono hedžovať treba v začiatkoch, čiže ak napr seluješ a zistíš že si nepredal na vrchole a trh ide proti tebe, trend je silný/dynamický alebo si dosiahol stratu v hodnote 2 násobku bežného zisku, ktorú pri danej pozícii berieš vtedy je pravidlo hedžu čiže hedžovať ak si zistil, že nastup nebol ten správny a cena uletela ďalej long pri sell obchode, t.j. nie falošny prírriez no keď nastal trend

-samozrejme pri tu popísanom štýle obchodovania ak obchodujete cenu netreba hedžovať pri každej korekcii, no ak sa zmenil trend a vytvorila sa nová protitrendová prvá vlna po ktorej nastala korekcia a po nej začiatok 3 vlny v protitrende vašeho pôvodného obchodu tam zahedžovať môžete je to na zväžení obchodníka - ak by už však výška straty na pôvodne otvorenom obchode bola dvojnásobkom zisku, ktorý priemerne na danom množstve beriete alebo by výška straty presiahla 2 násobok profitu ktorý ste zobrali za daný mesiac, alebo by výška straty presiahla o 100 % celkový sľosnutý zisk na celkovo ziskovom účte potom už je hedžing v takejto situácii pravidlo, ktorého sa treba držať z dôvodu, aby straty boli limitované obmedzené a takto, aby ste mali mantinely pre udržanie si zisku v periode aj pre celý účet.

Samozrejme pravidlá/ kritériá kedy už podľa pravidiel treba hedžovať si môžete nastaviť aj konzervatívnejšie prísnejšie, čo je pre vás optimálne tak aby ste s tohto pohľadu znížili risk a maximalizovali udržanie vytvoreného zisku to vám ukáže prax na mieru podľa vašeho obchodného štýlu.

Môžete mať obdobie testovania prísnosti pravidiel hedžingu no ak chcete testovať je prípustné testovať len nižšie riziko t.j. skorší hedžing ako podľa tu uvedených čísel pravidiel.

Je to tak preto, aby ste účet nevystavovali experimentom, pri ktorom by mu hrozili vyššie uvedené straty ako pri tu uvedených pravidlách.

Ak si pravidlá hedžingu pre Váš štýl zoptimalizujete nastavíte pre váš obchodný štýl je vhodné zostať pri nich.

Definitívnu optimalizáciu by ste mali poznať tak po 3 mesiacoch pravidelného obchodovania t.j. to či napr. budete hedžovať ak strata dosiahne napr. 1,3, 1,5 alebo 1,7 alebo 2 násobok bežného zisku, ktorý na pozícii beriete a na celom účte pri closnutom profite pri danej komodite.

Príklad ak bežne na 0,01 pozícii beriete na komodite č.1 20 Eur a použili by ste hedžové pravidlo 1,3 potom by ste hedžovali ak otvorená strata dosiahne $20/100 * 130 = 26$ Eur

Ak bežne na 0,01 pozícii beriete na komodite č.2 20 Eur a použili by ste hedžové pravidlo 1,7 potom by ste hedžovali ak otvorená strata dosiahne $20/100 * 170\% = 34$ Eur

Ak bežne na 0,01 pozícii beriete 20 a použili by ste hedžové pravidlo 2 násobku 2,0 - pri pravidle 2 násobku by bol hedž pri 40 eur otvorenej straty

Nájsť optimálne hedžové pravidlo závisí od vašeho obchodného štýlu, výšky účtu, a závisí aj od toho akú komoditu obchodujete pre každú bude optimálne niečo trochu iné

– tiež po nájdení pravidla môžete mať 2 levely hedžingu napr konzervatívny a rizikovejší

ak danú komoditu obchodujete v konzervatívnejšom mode použijete konzervatívny model ak danú komoditu obchodujete vo viac rizikovejšom hedžingovom modeli použijete dané nastavenie, je to podobné ako optimalizácia stop losu tu optimalizujete hedžing

Ak už pre danú komoditu napr. Po 3 mesiacoch budete mať vyprofilované hedžové úrovne môžete si nastaviť napr. 2 tj. 1 konzervatívne a 1 rizikovejšie pásmo ako pevné pravidlo.

Výskumom bolo zistené, že ľudská adaptácia na nové pravidlá je ťažšia preto by ste ich nemali príliš často meniť ak ste si už pásmo vyprofilovali a hodnoty hedžu sa vám osvedčili pre danú komoditu.

Samozrejme ak by sa napr raz za rok zmenila volatilita danej komodity podstatne, potom by bolo potrebné sa tomu prispôbiť ide však o to aby ste nájdené hodnoty nemenili po vyprofilovaní každý mesiac, prvé 3 mesiace, kým to nemáte napevno nastavené samozrejme sú zmeny možné.

Tu uvedené pravidlá pre hedžing platia pre tento tu uvedený obchodný štýl tj obchodovanie bez stopov, kedy sú stopy nahradené úplne hedžingom.

hedž je robiť lepšie až po napr. opačnej červenej správe keď vidíš že trh má dôvod a silu ísť proti tebe, ak je pred správou a trh len vyčkáva, tzv vyčkávací hedžing môže skončiť skor v strate ako v zisku ak nevieš presne čo robíš a očakavania trhu na denný najbližší den a pod. čiže obmedziť vyčkávacie hedžingy a robiť hlavne faktami podložené/tj po červených správach alebo silou trendu podložené hedžingy ak sa trh po sprave rozbehne proti tebe a je dynamický, uhol ema12 je prudší nie rovinka, momentum nie je blízko nanesenej úrovne 100 ani neosciluje okolo 100 stredovej úrovne.

-tj hedžing nerobiť ak je trh do strany, bez trendu, správa nevyvolala dynamický pohyb/trend samozrejme číselné pravidlo má vždy prednosť tj. Ak by bola celková otvorená strata na účte vyššia o 100 % a viac ako celkový closnutý zisk účtu vtedy hedžovať treba

-hedžing robiť ak nastal protitrend tvojho obchodu a tento trend je silný, má dynamiku v pásme od dynamického po priemerný trend

robiť hedž ak momentum je jasne hore alebo dole pod 100 kou, ak protitrend je výsledkom správy, ktorá po výjední správy protitrend podporuje

z hedžingu treba vystúpiť ak sa dokončí nová technická formácia protitrendu tj. Je nové dno alebo vrchol,

pretože iba takýto hedž ti zminimalizuje stratu s pôvodne otvorenej pozície to je pravidlo

-čiže ak máš napr. otvorené dlhodobejšie 3-7 dnové pozície v smere dlhodobého napr sell trendu no momentálne krátkodobý/strednodobý trend je zrazu longový tak hedžingom limituješ stratu a na vrchole krátkodobého protitrendu hedž ukončíš tj realizuješ s ním zisk.

Následne ak sa postupne dlhodobý sell trend obnoví predávaš znovu na nových vrcholoch.

Ak si si myslel, že si predal na vrchole, no trh ide proti tebe je podľa pravidla treba hedžovať vždy akonahle :

-trh prerazil support/rezist a nejde o falošný prírriez/napr. Pri kovech gold silver idú oba rovnakým smerom a pod.

-ak otvorená strata presiahne 2 násobok toho čo bežne na pozícii berieš tj ak berieš 20 tak pri 40 je podľa pravidiel hedž treba otvoriť, následne ho treba ukončiť ak trh dokončí technickú formáciu dno

vrchol.vrchol býva dokončený ak 2 alebo viacere rezistencie po sebe na hodinovom bary indikatore sú nižšie ako predchádzajúce,ak na eme 12 vznikla rovinka viac ako 1 cm alebo cena osciluje okolo rovnakej hodnoty 6 a viac hodín.

Tiež je indikáciou zlomenia vrcholu to,že pôvodné kladné momentum nad 100 sa zrazu dotkne 100 kovej stredovej nanesej línie,vo VT to bola stredová nulová línia pre dlhšie obchodujúcich traderov-to čo bola nulová stredová pre VT je 100 ková add nanesej stredová uroven

Position sizing – aby ti účet prežil aj cunami vlnu,ktorá býva cca raz za rok maximum otvorených pozícií v jednom čase pre napr 2000 eur účet je 0,30 lotu spolu ak toto dodržíš,tvoje šance,že účet prežije dlhodobo sa zvýšia o cca 200 %
-ak hedžuješ podľa pravidiel vždy,tvoje šance dlhodobo prežiť na trhu sa zvýšia o 100 %
-šanca dlhodobo prežiť je tiež zvýšená o 75 % ak tvoríš rôznorodá portfolio 4-12 produktov
-šanca dlhodobo prežiť je zvýšená o 100 % ak 80 % tvojich obchodov obchoduješ tie 3 produkty,pri ktorých máš za posledný štvrtrok/rok najlepšie štatistické výsledky úspešnosti obchodov,čo sa môže časom meniť preto treba svoju úspešnosť pri roznych produktoch pozorovať a vyhodnocovať v pravidelne stanovených intervaloch napr raz mesačne robit uzávierku úspešnosti produktov v % pre peridy.

Ja mám napr. momentálnu najvyššiu štatistickú úspešnosť pre gold,silver 80 % úspešnosť obchodov Pali díky za štatistiku, pre selové obchody pre longy o niečo menej a ty ?

-obchodovanie ti môže kazit' zotrvačnosť myslenia ak napr 6-12 mesiacov bude sell trend a ty ho budeš úspešne obchodovať a náhle príde longová krátkodobá perioda, je riziko,že budeš stále podvedome račej chcieť robit' selly aj kde trh zmenil názor,alebo preto,že si mal v nich dlhodobo lepšie výsledky.

Je preto vhodné a potrebné byť flexibilný,ak ta longy bavia menej a je krátkodobo long trh,môžeš robit' menej long pozícií,prípadne longovými obchodmi hedžovať pôvodné sell pozície ak sú otvorené

Prajem Vám veľa úspechov v úspešnej aplikácii postupov a teším sa na vaše skúsenosti s novým štýlom tradingu

Vyhliadky pre gold silver som toho názoru,že do 3-6 mes.(dnes je 1.3.2014) A trhy vrátia k pôvodným hodnotám pred cunami vlnou, keďže inflácia v globále zatiaľ nehrozí,pôvodné zlé čísla sa časom pre usd budú vylepšovať,qe sa bude utlmovať preto pomalšie ako sa čakalo,kvôli prechodnému zhoršeniu us dát

<http://forexkomodityakcieakoinvestovatnaburze.cheapindex.com>

© 2014 Trader Robo