Стратегия построена на базе трендового индикатора – пересечение MA 5 и 30 на часовом ТФ. Актив для стратегии – BCOUSD, поскольку я торгую на Just2Trade и тикеры по нефти в Just2Trade не совпадают с тикерами в TV, где я веду аналитику. Я уже давно выставляю заявки, стопы и тейки на основании BCOUSD, просто подстраивая каждый раз под разницу с J2T.

Для оценки возможности входа в сделку при пересечении MA 5/30 на часе анализируются дополнительные индикаторы:

1. Пересечение линии кинджун в том же направлении в пределах 7 свечей
2. Пересечение RSI 50 в том же направлении в пределах 3 свечей

Вход в сделку происходит по последнему сработавшему индикатору.

Стоп -по свече входа + 20 центов на спрэд в J2T.

Выход по стратегии осуществляется по обратному пересечению МА.

При этом есть дополнительные фильтры на вход. Эти фильтры я проанализировала на истории с 23 августа 2021 года по текущий момент. Они дают очень хороший результат, позволяя отфильтровать большое количество убыточных сделок.

Фильтры, которые ОТМЕНЯЮТ вход:

1. Чайкин дал противоположный сигнал в пределах трех свечей до входа
2. Чайкин выше 14000 или ниже 14000
3. Пересечение тенкан и кинджун дали противоположный сигнал в пределах трех свечей до входа
4. Длинный стохастик (18-7-7) дал противоположный сигнал в пределах 3 свечей
5. RSI находится вне зоны входа (от 47 до 52 или ниже 37,5). В промежутке от 47 до 52 в сделку не входим, так же как и в шорт ниже 37,5.
6. Сделка не на часовом отрезке 14:00 и 15:00. В это время по истории все сделки убыточны. Была только одна прибыльная сделка с прибылью 2%, поэтому сигналы в этих временных точках я исключила до появления первой прибыльной сделки с доходностью хотя бы 4%. При появлении такой сделки пересмотрю этот пункт.
7. Явно определяемый боковик (определяем на третьей вершине). В этом случае в сделки на 4 и 5 вершине не входим, торгуем, начиная с 6 вершины.

Так же на истории я определила сигналы, при которых в сделку можно войти двойной позицией, то есть усилить риск в 2 раза, поскольку исторически сделки с такими сигналами дают прибыль выше 25%. Этими сигнала на удвоение входа являются:

1. Пересечение на одной свече 3 (трех) EMA – 5, 30 и 60
2. Стохастик 14-3-3 или стохастик 18-7-7 ВМЕСТЕ пересеклись в КЗ и дали выход из КЗ, при этом в пределах 4 свечей осциллятор Чайкина дал сигнал в ту же сторону.

Также важное дополнение. Торговля по этой стратегии предполагается в диапазоне 10:00 – 22:00 Мск, поскольку требует минимального присутствия онлайн. Допустимы входы в сделку в 23:00, если накануне видно возможное пересечение. Кроме того, исторически самыми выгодными сделками оказались те, где вход должен был бы состояться ночью – около 4-5 утра. Как правило, после пересечения МА в это время происходит боковик до выхода Европы на рынок, поэтому в таких случаях вход по стратегии происходит в 10:00 утра – по 10-часовой свече.