

Strategia Lindy Raschke

Większość z Państwa inwestuje na rynkach walutowych czy innych instrumentach, które mamy w ofercie, w dość krótkich interwałach czasowych – od M5 do H1. W celu przybliżenia Państwu metod pracy znanych daytraderów chciałbym z czasem przygotować dla Państwa dość kompleksowy zestaw różnego rodzaju propozycji strategii, które po drobnych modyfikacjach mogą pozwolić Państwu osiągać bardzo atrakcyjne wyniki, a ich poszczególne elementy mogą być cennym dodatkiem do Państwa własnych systemów.

Na pierwszy ogień pójdzie system o nazwie Holy Grail, niezwykle prosty w obsłudze, stworzony przez jedną z najbardziej znanych na świecie kobiet traderów, Lindę Raschke, której dokonania zostały opisane m.in. w książce Jacka Schwagera *The New Market Wizards*. Linda Raschke zajmuje się niemal wyłącznie daytradingiem, stąd też większość jej propozycji ma zastosowanie głównie w krótkich interwałach.

Strategia, którą przedstawiam była stosowana przez autorkę na kontraktach futures na indeks S&P500, dlatego zachęcam, by przetestować jej funkcjonowanie właśnie na tym instrumencie (US.500), czy pokrewnych – US.30, W.20, EU.50, itd.

Holy Grail Pattern – zasady inwestowania

Warunki otworzenia długiej pozycji:

1. 14-okresowy odczyt wskaźnika ADX musi początkowo być większy niż 30 i rosnący.
2. Oczekujemy na moment korekty, która dojdzie do poziomu 20-okresowej eksponentyjnej średniej ruchomej (EMA).
3. W momencie, gdy korekta nastąpi, składamy zlecenie typu Buy Stop na poziomie High poprzedniej świecy +1 pips.
4. W momencie, gdy transakcja zostanie otworzona, ustawiamy zlecenie SL poniżej lokalnego minimum (tego, które nastąpiło po momencie złożenia zlecenia Buy Stop).

Warunki otworzenia krótkiej pozycji:

1. 14-okresowy odczyt wskaźnika ADX musi początkowo być niższy niż 30 i rosnący.
2. Oczekujemy na moment korekty, która dojdzie do poziomu 20-okresowej eksponentialnej średniej ruchomej (EMA).
3. W momencie, gdy korekta nastąpi, składamy zlecenie typu Sell Stop na poziomie Low poprzedniej świecy -1 pips.
4. W momencie, gdy transakcja zostanie otworzona, ustawiamy zlecenie SL powyżej lokalnego maksimum (tego, które nastąpiło po momencie złożenia zlecenia Sell Stop).

Kluczowe elementy systemu:

ADX (Average Directional Movement Index)

ADX jest narzędziem służącym do identyfikacji trendu, opisanym w słynnej książce Wellesa Wildera "New concepts in technical trading systems". Na platformie znajdą go Państwo w zakładce Wskaźniki>Trend>Average Directional Movement Index.

Najprostszą metodą wykonywania transakcji przy wykorzystaniu ADX jest porównanie dwóch wskaźników kierunku: 14-okresowego +DI i 14-okresowego -DI. Wilder rekomendował kupowanie, gdy +DI znajduje się powyżej -DI i sprzedaż w przeciwnym przypadku. Jak można zauważyć, momenty krzyżowania się linii powinny pokazywać potencjalne punkty zwrotne. Warto dodać, że w momencie uzyskania sygnału należy wstrzymać się z wejściem w pozycję do momentu, gdy cena wybije poziom ekstremum z momentu przecięcia.

$$ADX = \frac{\text{SUMA}[(+DI - (-DI)) / (+DI + (-DI)), N]}{N}$$

Gdzie:

UpMove = High z tego okresu – High z poprzedniego

DownMove = Low z tego okresu – Low z poprzedniego

jeżeli UpMove > DownMove i UpMove > 0, +DM = UpMove, w innym wypadku +DM = 0

jeżeli $\text{DownMove} > \text{UpMove}$ i $\text{DownMove} > 0$, $-\text{DM} = \text{DownMove}$, w innym wypadku $-\text{DM} = 0$

$\text{DI} = 100 \times \text{EMA } +\text{DM}$ podzielona przez ATR

$-\text{DI} = 100 \times \text{EMA } -\text{DM}$ podzielona przez ATR

N – ilość okresów użytych w obliczeniach

Linda Raschke korzysta z wskaźnika ADX inaczej niż przytoczony klasyczny sygnał, stosuje jako sygnał kupna sytuację, gdy ADX (14) przekracza poziom 30 i rośnie. Warunek jest taki sam niezależnie od tego, czy jesteśmy zainteresowani otworzeniem długiej czy krótkiej pozycji, ponieważ ADX nie wskazuje kierunku trendu, a jedynie jego siłę. Z tego powodu możemy w ogóle usunąć linie DI i $-\text{DI}$ na potrzeby tego systemu w celu uzyskania większej czytelności.

Jak łatwo zauważyć, w omówionym setupie rynkowym brakuje sposobu ustawiania TP. Propozycji, nad którymi warto się zastanowić jest kilka.

1. Ustawienie TP w takiej samej lub proporcjonalnie większej odległości na podstawie tego, gdzie znalazło się zlecenie SL.
2. Brak TP, korzystanie wyłącznie z Trailing SL w tej samej odległości co SL.
3. Wykorzystanie 3-10 Oscillator.
4. Wykorzystanie Keltner Channels.

3-10 Oscillator

Pod tą nazwą kryje się proste narzędzie techniczne, które pokazuje po prostu różnicę pomiędzy 3-okresową prostą średnią ruchomą (SMA), a 10-okresową prostą średnią ruchomą. Druga linia to 16-okresowa średnia ruchoma linii pierwszej. Wskaźnik najłatwiej uzyskać poprzez zmianę sposobu wyznaczania średniej w MACD z eksponentyjnej do prostej oraz ustawienie poszczególnych parametrów na 3,10 i 16. Jako sygnał wyjścia z pozycji Raschke stosuje wystąpienie dywergencji na oscylatorze (do materiałów załączam również wersję MACD z dwoma średnimi dla tych z Państwa, którzy jej jeszcze nie mają. Instalacja identyczna jak w przypadku Keltner Channels).

Keltner Channels

Narzędzie techniczne, którego nie znajdują Państwo na platformie MT4 (zostało przeze mnie załączone w odpowiednim pliku, który należy zainstalować w katalogu Experts>Indicators. Pojawi się wtedy na platformie od następnego uruchomienia w zakładce Wskaźniki>Własne.

Keltner Channels to 20-okresowa eksponentencjalna średnia krocząca (EMA) plus dwie linie oddalone od niej 2,5x wartość ATR. Za sygnał wyjścia z pozycji uznajemy sytuację, gdy cena dotknie odpowiedniej linii kanału.

Warto dodać, że dwie ostatnie wersje zamykania pozycji będą ograniczały skuteczność systemu, pozwalając jednak bardzo zwiększyć swoje RR. Zalecałbym je raczej dla osób o mocniejszych nerwach.

Zachęcam Państwa do eksperymentów z systemem i z poszczególnymi jego elementami. W szczególności osoby, które korzystają z Bollinger Bands namawiałbym na sprawdzenie, czy Keltner Channels nie sprawdzą się lepiej w ich strategiach. W przypadku jakichkolwiek pytań oczywiście jestem dostępny pod mailem.

Ja sam testując system na różnych interwałach i instrumentach doszedłem do wniosku, że kryterium $ADX > 30$ może być zbyt radykalne i mocno ogranicza liczbę potencjalnych wejść. Z tego powodu zachęcam do sprawdzenia, czy poziomy 20-25 nie sprawdzą się lepiej. Można też korzystać jedynie z warunku, że ADX musi być rosnące.

Jednym z najważniejszych elementów systemu jest to, że nie wchodzimy od razu po teście średniej (bo dość często będzie przebijana), a jedynie ustawiamy zlecenie typu stop.

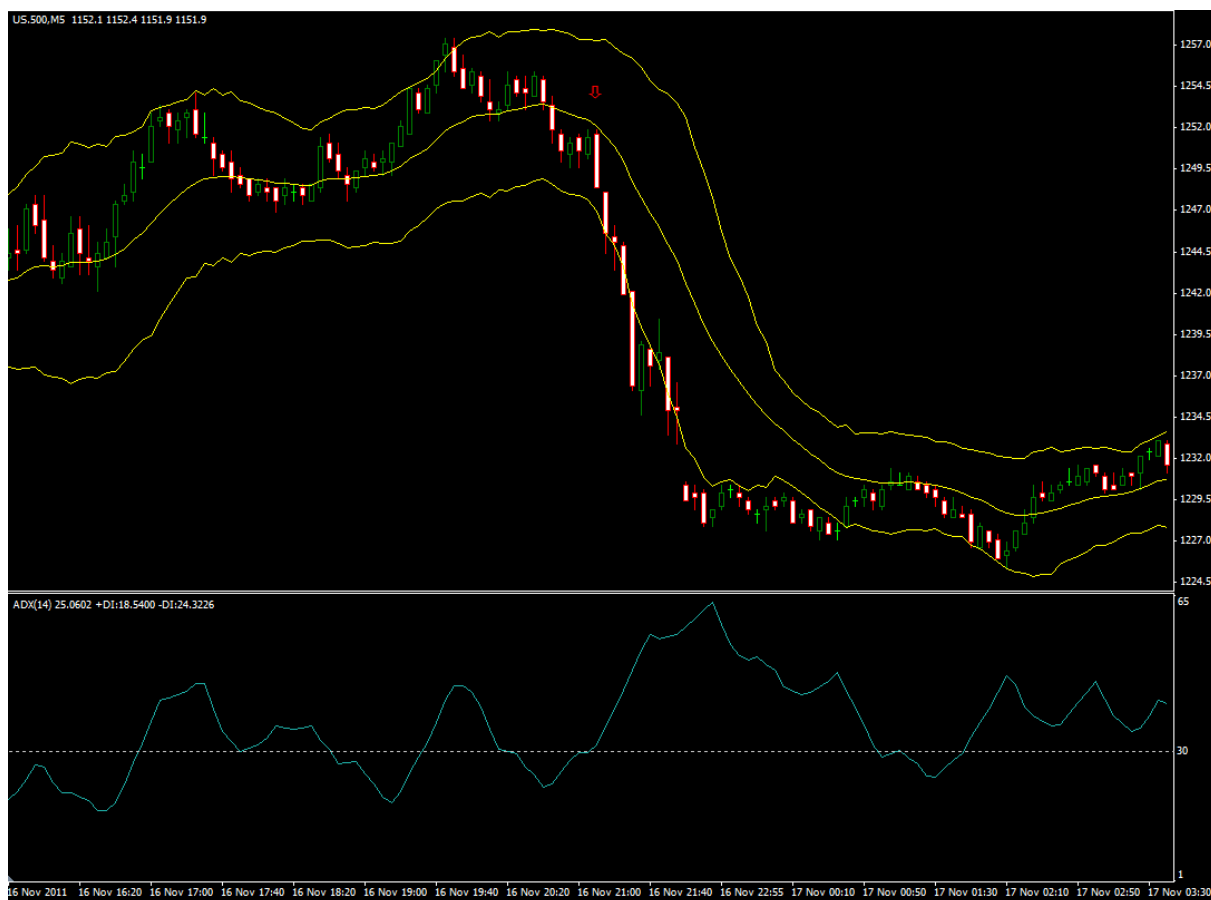
Warto poeksperymentować na konkretnym wykresie z ilością okresów EMA, które powinno być dobrane tak, żeby rzeczywiście regularnie dostarczało wsparć/oporów. Jeżeli widzimy, że EMA(20) jest na naszym instrumencie regularnie przebijane, zmienmy je.

Na następnych stronach znajdują Państwo przykładowe wejścia.

Pozdrawiam.

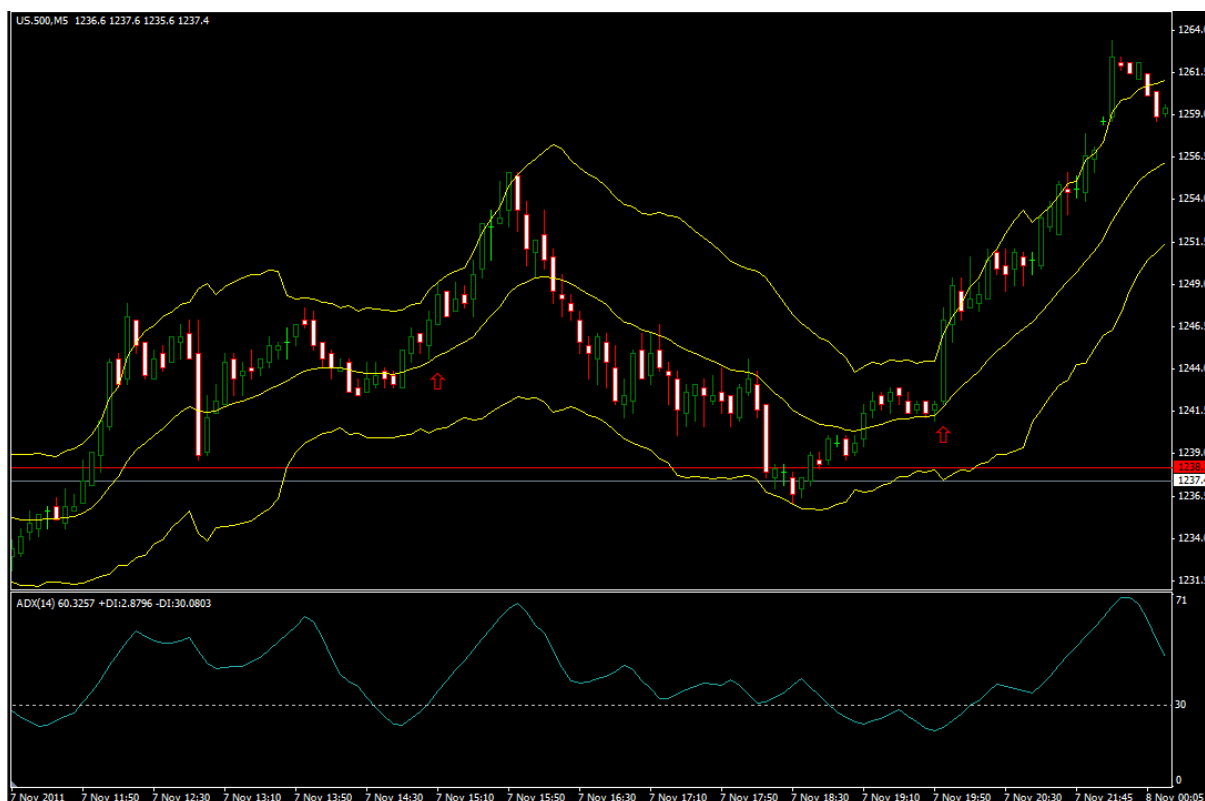
Kamil Cisowski

Przykład pierwszy – sygnał pozycji krótkiej



Na wykresie widzimy, że wykres na M5 przebija EMA, a siła trendu spadkowego zaczyna rosnąć. Test średniej od dołu następuje w momencie, gdy ADX przebija się przez poziom 30. Zlecenie Sell Stop zostaje złożone na zamknięcie czerwonej świecy, która testowała średnią i od razu zrealizowane.

Przykład 2 – sygnał pozycji długiej



Na wykresie zaznaczono dwa przykładowe wejścia. W pierwszej sytuacji doszło do wybicia EMA(20) i po dwóch świecach powyżej rynku przetestował średnią. Sygnał pojawia się na zamknięciu pierwszej świecy o zielonym korpusie, a zlecenie Buy Stop zostaje zrealizowane w następnej.

Drugie wejście wygląda podobnie, po teście średniej powinniśmy złożyć zlecenie Buy Stop, które niezwłocznie by zostało zrealizowane. Należy pamiętać zawsze o spełnieniu warunku ADX.

Przedstawione w powyższym opracowaniu treści, sporządzone z najwyższą starannością i według najlepszej wiedzy autora, mają charakter wyłącznie informacyjny. Nie stanowią one porady inwestycyjnej, ani rekomendacji w rozumieniu rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 19 października 2005 r. (Dz. U. z 2005 r. Nr 206, poz. 1715) w sprawie informacji stanowiących rekomendacje dotyczące instrumentów finansowych, ich emitentów lub wystawców. Dom Maklerski X-Trade Brokers S.A. nie ponosi odpowiedzialności za decyzje inwestycyjne podjęte na podstawie powyższych danych, ani za szkody poniesione w ich wyniku. Transakcje na instrumentach inwestycyjnych, w szczególności instrumentach wykorzystujących dźwignię finansową zawsze związane są z ryzykiem i mogą w efekcie przynieść zyski oraz straty, przekraczające zaangażowany przez inwestora kapitał początkowy.