

The Killing Floor



Sis.yphus

Welcome to The Killing Floor!

Proszę ochroń ten czat od wszystkiego co nie związane jest z tą strategią lub pokazywane jest z innego wątku. Strategia może się zmieniać od czasu do czasu, ale w przeważającej części pozostanie bardzo stała. Jeśli to się zmieni, to wyłącznie z powodu pojawienia się statystycznego powodu. Wielu powie, że to jest zbyt proste i nie ma sposobu, żeby to zadziało ... Szczerze mówiąc, nie obchodzi mnie to, bo dostaję zapłatę za pipsy, a nie opinie. Dowody na opłacalność z wejść generowanych przez system są załączone.

Why Is It Called The Killing Floor?

Większość ludzi, którzy każdego dnia wchodzi na rynek, tam umierają. Spędzają cały dzień na ostrzeniu swoich narzędzi, ale nigdy nie ćwiczą swoich technik. W rezultacie są pokarmem dla wilków. Dziewięć razy na dziesięć, nie liczy się siła twojej broni, ale twoja zdolność do maksymalizacji użyteczności.

Celem każdego dnia jest uderzenie w podłogę tak mocno, jak to tylko możliwe, aby zabić jak najwięcej pipsów. W niektóre dni zostajesz zabity na podłodze, ale w większości dni powinieneś zejść z pola bitwy zatopionego w pipsami twoich wrogów.

Narzędzia naszego systemu:

Pary: EURUSD & USDJPY

Rama Czasowa: 5 Minut

Wskaźniki:

200 MA

50 MA

10 MA

Zarządzanie Ryzykiem:

36 Pip SL

4 Pip TP

Max 1:1 Lewar na zlecenie.

Nieposiadanie FIFO pomaga. Jeśli jesteś w USA, możesz to ominąć używając OANDA-y, musisz tylko że każdy trejd będzie miał inną wielkość lota (1000, 1001, 1002, 1003)

Idealnie byłoby, gdyby twój spread był poniżej równy 0.5 Pipsa.

Każdy spread powyżej 1,5 pipsa będzie bardzo trudno używać.

Wszystkie wykresy poniżej posiadają spread w wysokości 1,5 Pipsa. Jeżeli masz niższy spread możesz spodziewać się lepszych wyników.

Maksymalny czas trzymania pozycji: 1000 świec (około 3,5 dnia).

Idealnie byłoby gdybyś nie zaklinował się z trejdem tak długo.

Additional Resources:

[The Anatomy of a Loser](#)

[Don't Like The R:R? Change It!](#)

[More Data for Better Decision Making](#)

[Equity Progression Exercise](#)

[Good Thread to Learn a More About High Hit Rate Trading Styles](#)

Ważne Uwagi

Jeśli spróbujesz w 100% zautomatyzować ten system, uzyskasz bardzo różne wyniki. Zarządzanie trejdami jest kluczowe. Musisz wiedzieć, kiedy układać wejścia w stopy, dostosowywać wszystkie poziomy TP do najdalszych zleceń 4-ro pipsowych TP, ciąć straty, a co najważniejsze, musisz wiedzieć, kiedy przestać handlować w oparciu o rzeczy SPOZA rynku. Takie jak twój nastrój, poziom energii, stan emocjonalny po wielkich pasmach wygranych lub kilka większych strat.

Jeśli chcesz celować w większe zyski, zdobądź niewielkie np. 4 zyski w jedną pulę podczas trejdingu większego ruchu, aby utworzyć bufor dla konta do obsługi wypłat / zwrotów.

Mimo że mamy 7 możliwych wejść, nie oznacza to, że musisz zagrywać każdy z nich za każdym razem. W rzeczywistości, nie ... Będziesz zbierał swoje marże jak szalony. Główną zasadą jest to, że masz dobre pojęcie o tym, co może nastąpić za każdym razem.

Zastosowany Stop Loss jest twardym stopem dla najgorszych scenariuszy, takich jak utrata połączenia, wypadki w terminalu itp. Powinieneś zmniejszyć straty, zanim twój twardy stop zostanie uderzony w NAJGORSZYCH PRZYPADKACH. Biorąc to pod uwagę, jest w porządku, kiedy cena nieco cofa się poza pozycję.

Bierz pod uwagę fundamenty! Nie kupuj EUR po tym, jak Draghi ogłosił, że nie będzie podwyżki stóp, podczas gdy FED zrobił to kilka dni wcześniej. Stracisz, a mogłeś zobaczyć, że ten scenariusz nadchodził już z wielu kilometrów.

Nachylenie średniej spada, jeśli wartość średniej kroczącej na ostatniej świecy jest wyższa niż wartość na średniej kroczącej przy zamknięciu świecy. Vice Versa, jeśli nachylenie jest w górę. Większość szybkich ruchów rynku spowodowanych wiadomościami powinna zrealizować twój TP, jednak jeśli znajdziesz się w sytuacji, w której nie zadziałało TP podczas jednego z tych skoków, poświęć trochę czasu, aby zapewnić sobie jak najwięcej zysku i zmniejszyć ryzyko. Jeśli nie możesz wszystkiego zdjąć, wystartuj tak dużo, jak to tylko możliwe, ponieważ cena prawie na pewno ponownie przetestuje poziom i da ci świetną okazję do ponownego wejścia.

W razie wątpliwości ... Zapamiętaj dane. Prawie wszystkie z 7 wejść będzie miało 90% szans trafienia w cel w ciągu 1 dnia (288 5-minutowych świec) zajęcia pozycji, nawet TYLKO w przypadku trejdowania nachylenia 10 Średniej kroczącej, niezależnie od podstaw, sentymentów, odczuć w elitach, wszystkiego. Jest więc duża szansa, że trafisz w swój cel. Kluczem jest zmaksymalizować te trafienia, budując pozycję, aby podnieść średnią liczbę wejść i uzyskać większe wygrane. Najniższe wejście było pierwszym, oczywiście, wszystkie moje kolejne dodaje do pierwszego TP i używam tego samego SL co pierwsze wejście, więc R: R staje się lepszy. Zobacz zdjęcie poniżej.



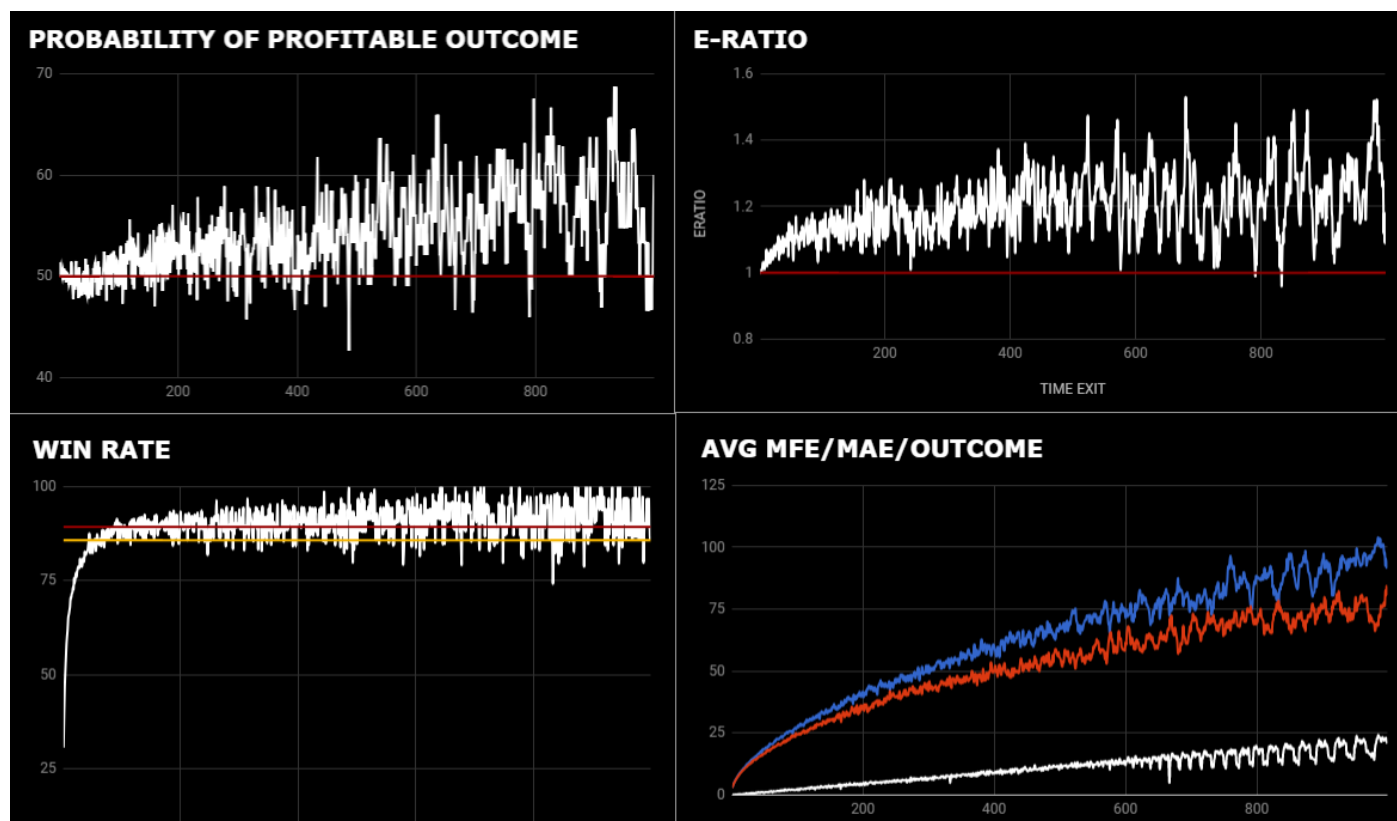
Jak Interpretować Obrazy Analizy Przewagi (EEI)

Mamy cztery wykresy w naszej EEIs.

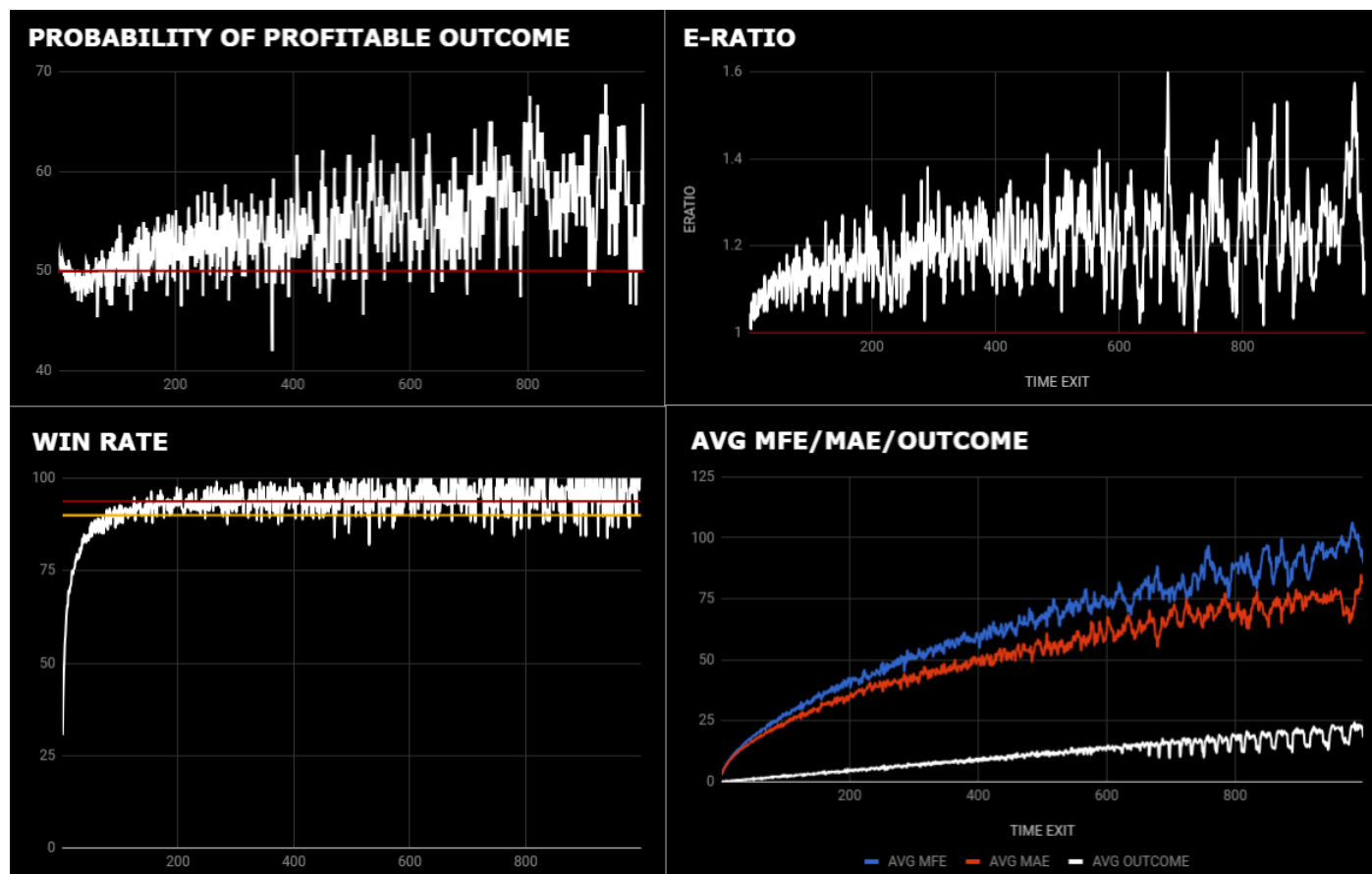
1. Pierwszy mówi nam o prawdopodobieństwie zakończenia trejdu z zyskiem, jeżeli zamkniemy go po x świeczkach po zajęciu pozycji na sygnale wejścia.
2. Drugi wykres pokazuje stosunek nasz stosunek do przewagi w kwestii maksymalnego czasu trzymania na bazie x danych MFE/MAE w wykresie 3.
3. Ten wykres obrazuje nasz przeciętny wynik MFE/MAE jeżeli weźmiemy sygnał z maksymalny czas trzymania wynosi x.
4. Ten wykres pokazuje nasz Win Rate używając SL i TP oparte na sygnale wejściowym w kwestii maksymalnego trwania czasu x. Żółte linie reprezentują win rate niezbędny do uzyskania BE. Czerwone linie pokazują maksymalny czas trzymania potrzebny do uzyskania BE po zapłaceniu naszych kosztów i spreadu.

Możliwe wejścia (7 Total EEIs):

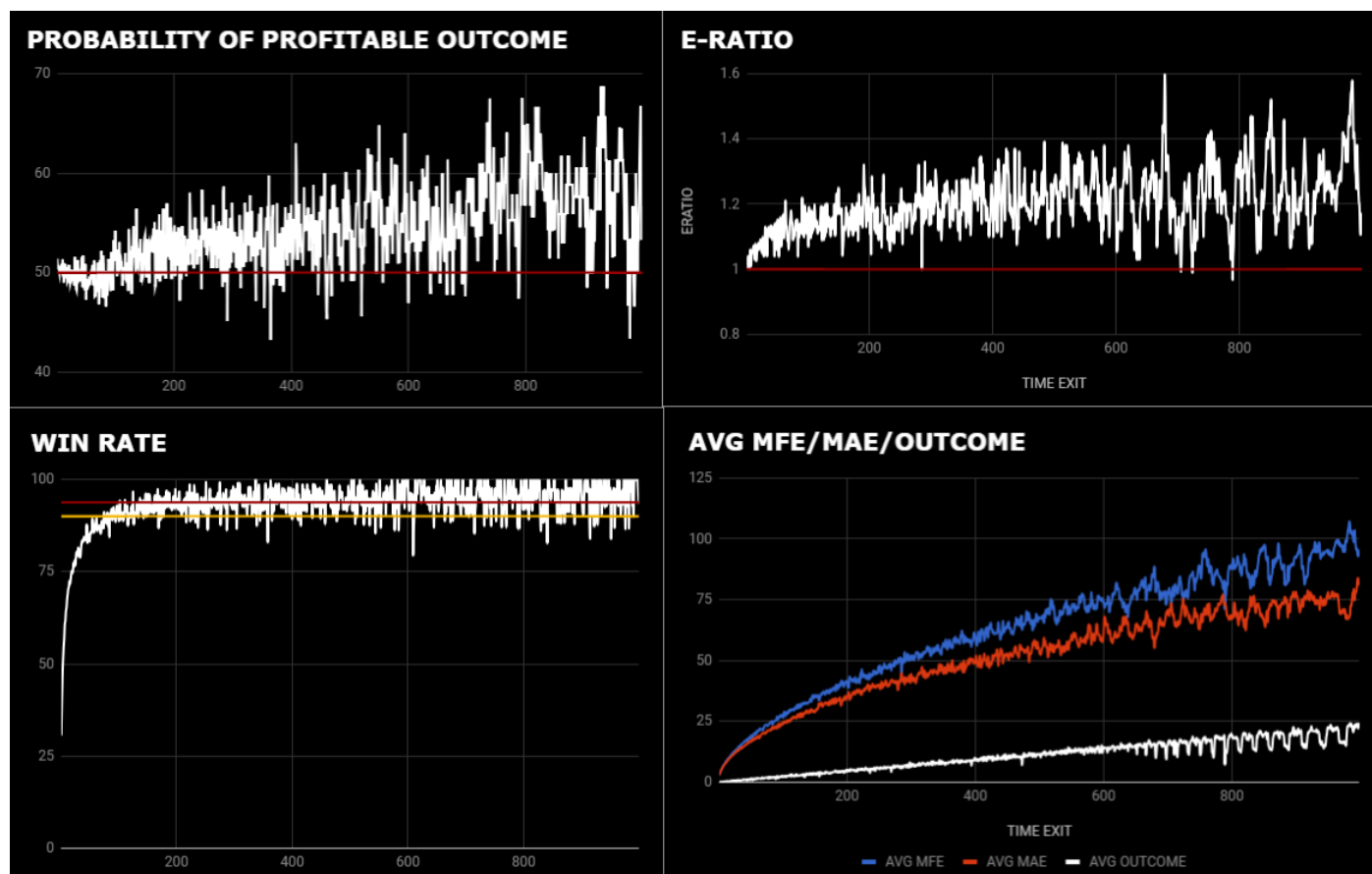
1C-200: Cena zamyka się powyżej 200 MA i nachylenie średniej jest do góry



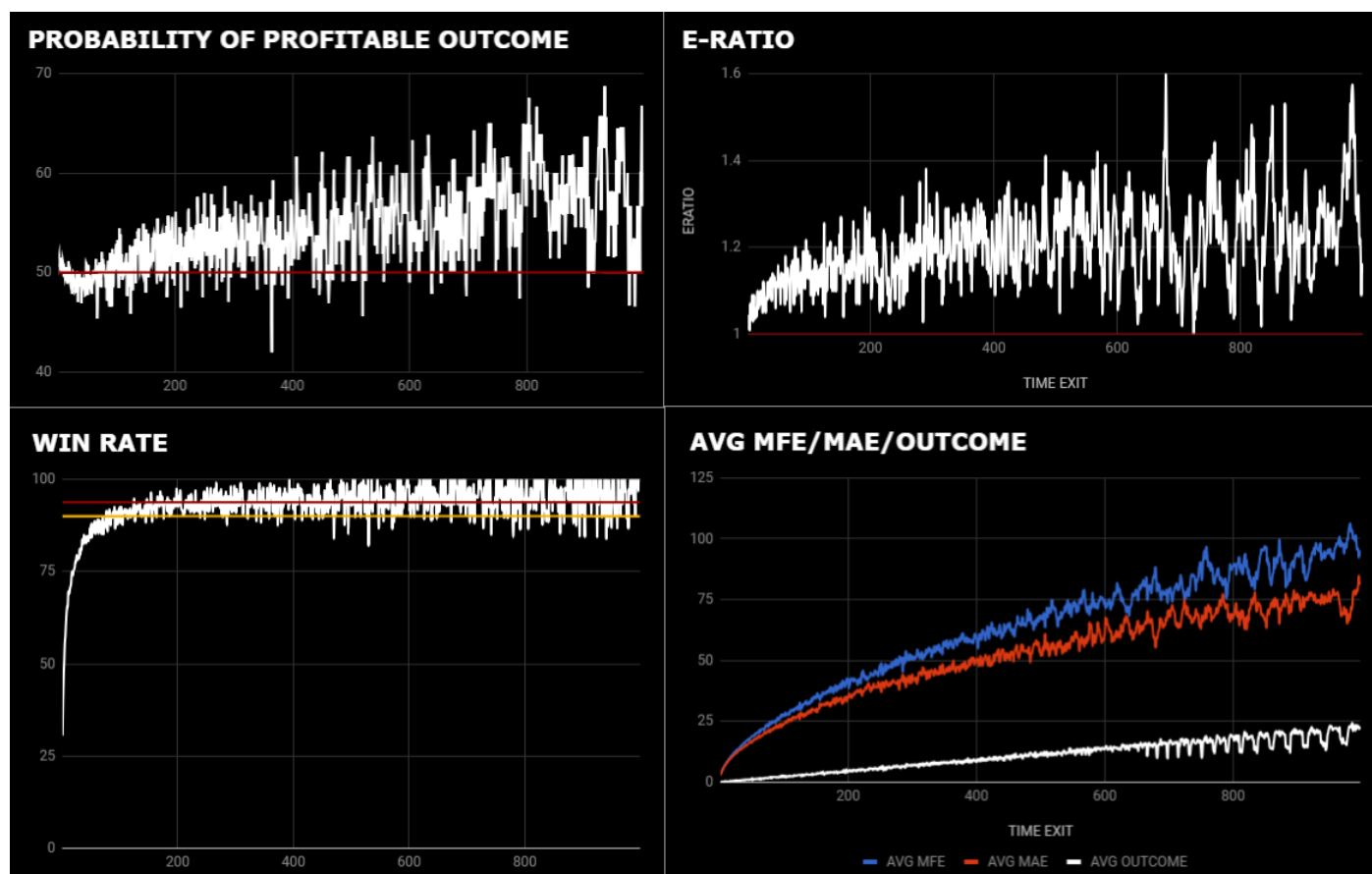
1C-50: Cena zamyka się powyżej 50 MA i nachylenie średniej jest do góry



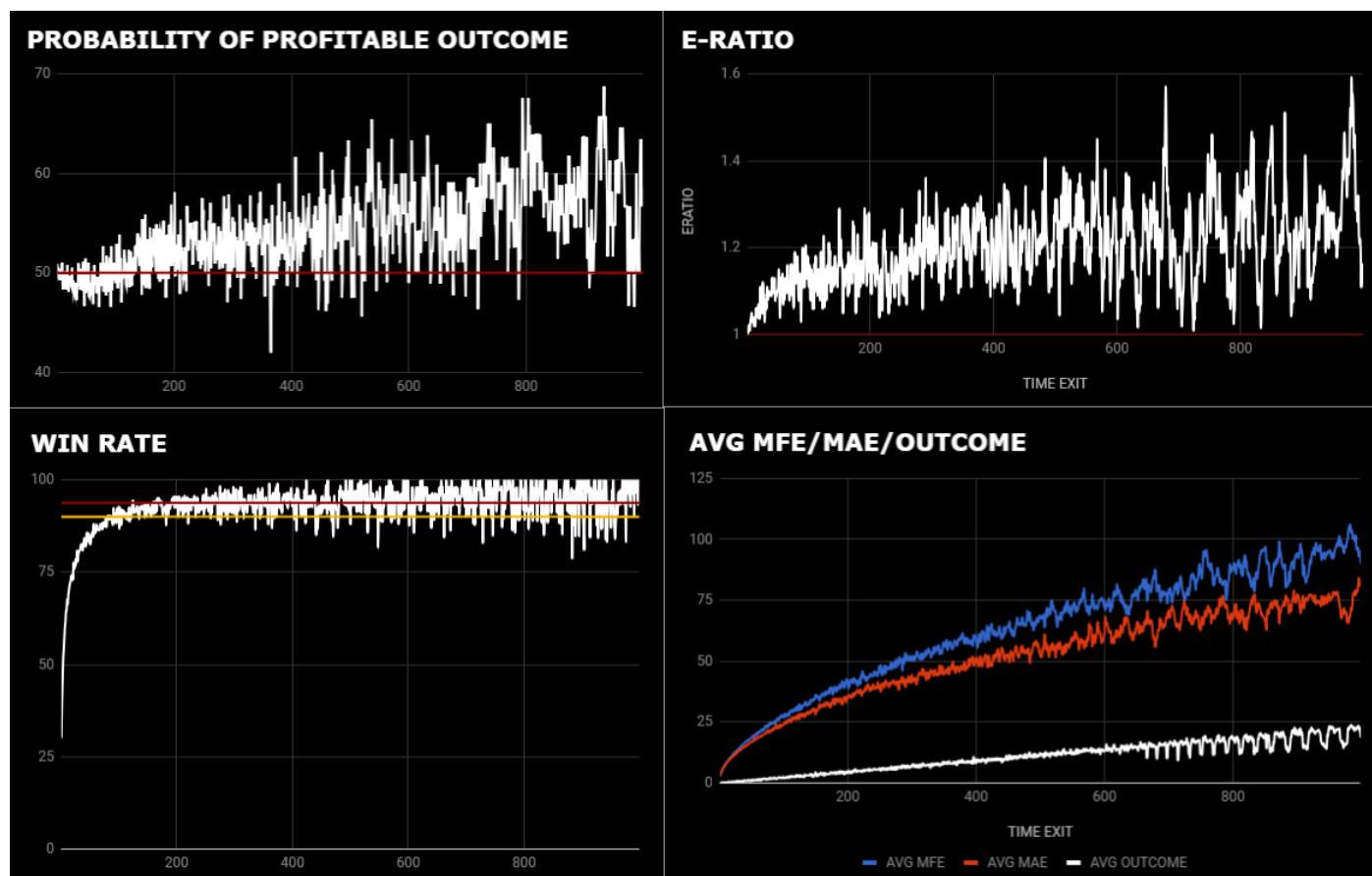
1C-10: Cena zamyka się powyżej 10 MA i nachylenie średniej jest do góry



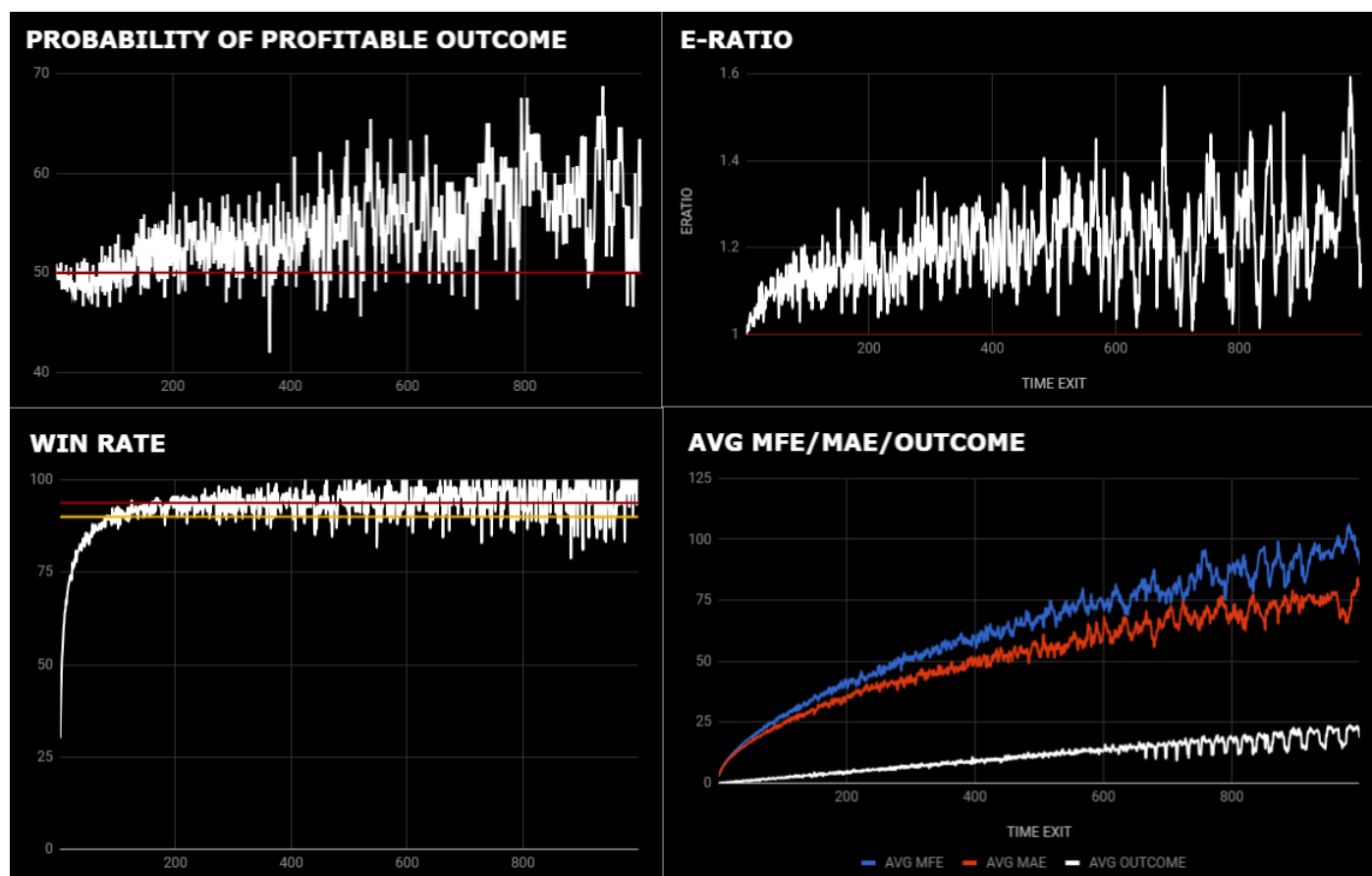
2C-200-50: Cena zamyka się powyżej 200 i 50 MA i obie średnie nachylone są do góry



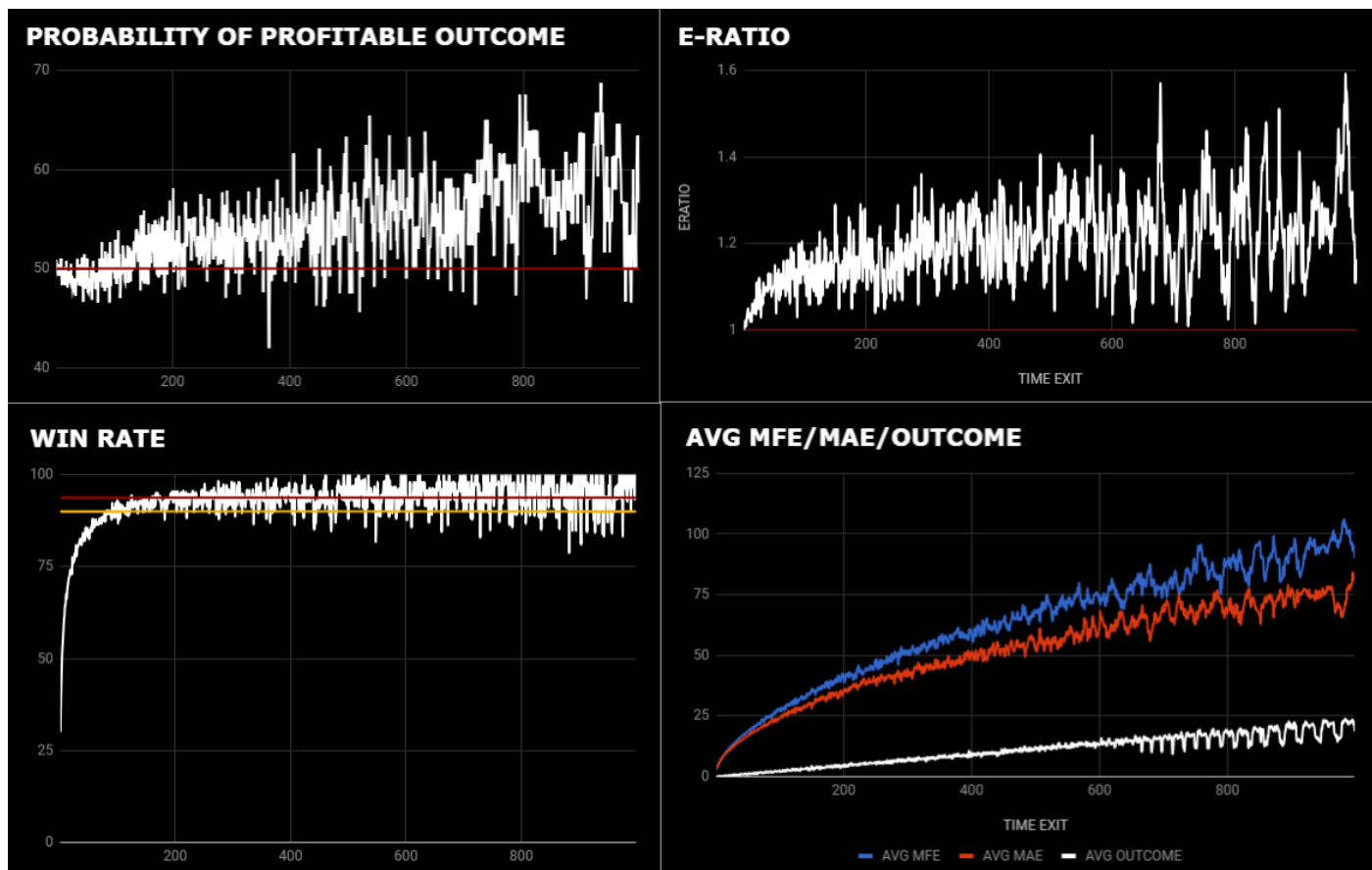
2C-200-10: Cena zamyka się powyżej 200 i 10 MA i obie średnie nachylone są do góry



2C-50-10: Cena zamyka się powyżej 50 i 10 MA I obie średnie nachylone są do góry



3C-200-50-10: Cena zamyka się and 200, 50, 10 średnimi i wszystkie średnie nachylone są do góry



Masz swoje wejścia, znasz ich przewagę. Jesteś gotowy do walki na polu bitwy!

Wczorajsze trejdy:

Trading Activity	Open Trades (4)	Open Orders (0)	History (36)	Exposure								More
Open Date	Close date	Symbol	Action	Open Price	Close Price	Pips	Duration	Gain				
18.06.2018 14:52	18.06.2018 15:56	EURUSD	Sell	1.16124	1.16071	5.3	1h 3m	0.06%				
18.06.2018 14:53	18.06.2018 15:54	EURUSD	Sell	1.16117	1.16080	3.7	1h 0m	0.04%				
18.06.2018 07:34	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15910	1.15751	15.9	2h 21m	0.19%				
18.06.2018 07:09	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15902	1.15752	15.0	2h 46m	0.18%				
18.06.2018 05:42	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15844	1.15758	8.6	4h 13m	0.11%				
18.06.2018 06:03	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15880	1.15762	11.8	3h 52m	0.17%				
18.06.2018 07:05	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15901	1.15769	13.2	2h 49m	0.16%				
18.06.2018 07:23	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15889	1.15766	12.3	2h 32m	0.15%				
18.06.2018 05:17	18.06.2018 09:55	EURUSD	Sell	1.15853	1.15772	8.1	4h 38m	0.10%				
18.06.2018 07:03	18.06.2018 07:28	EURUSD	Sell	1.15906	1.15892	1.4	24m	0.02%				
18.06.2018 07:03	18.06.2018 07:27	EURUSD	Sell	1.15910	1.15890	2.0	23m	0.02%				
18.06.2018 06:52	18.06.2018 07:03	USDJPY	Sell	110.41500	110.46100	-4.6	10m	-0.05%				
18.06.2018 06:35	18.06.2018 07:02	USDJPY	Sell	110.40300	110.44600	-4.3	27m	-0.06%				
18.06.2018 06:45	18.06.2018 07:02	USDJPY	Sell	110.39900	110.44400	-4.5	17m	-0.05%				
18.06.2018 06:30	18.06.2018 06:51	USDJPY	Sell	110.42100	110.40800	1.3	20m	0.02%				
18.06.2018 06:20	18.06.2018 06:42	USDJPY	Sell	110.43400	110.40400	3.0	21m	0.03%				

Trading Activity		Open Trades (4)	Open Orders (0)	History (36)	Exposure		More					
Open Date	Close date	Symbol	Action	Open Price	Close Price	Pips	Duration	Gain				
19.06.2018 15:46	19.06.2018 15:56	USDJPY	Sell	109.89700	109.87800	1.9	9m	0.02%				
19.06.2018 15:04	19.06.2018 15:14	EURUSD	Sell	1.15377	1.15338	3.9	9m	0.05%				
18.06.2018 21:57	19.06.2018 09:41	EURUSD	Sell	1.16169	1.15912	25.7	11h 44m	0.31%				
18.06.2018 16:31	19.06.2018 09:41	EURUSD	Sell	1.15980	1.15912	6.8	17h 10m	0.08%				
18.06.2018 16:18	19.06.2018 09:41	EURUSD	Sell	1.15989	1.15916	7.3	17h 23m	0.09%				
18.06.2018 16:18	19.06.2018 09:41	EURUSD	Sell	1.15957	1.15916	4.1	17h 23m	0.05%				
18.06.2018 16:25	19.06.2018 09:39	EURUSD	Sell	1.16015	1.15922	9.3	17h 13m	0.11%				
18.06.2018 16:50	19.06.2018 09:39	EURUSD	Sell	1.16054	1.15925	12.9	16h 49m	0.15%				
18.06.2018 17:30	19.06.2018 09:39	EURUSD	Sell	1.16053	1.15929	12.4	16h 9m	0.15%				
18.06.2018 20:57	19.06.2018 09:39	EURUSD	Sell	1.16110	1.15931	17.9	12h 42m	0.22%				
18.06.2018 21:42	18.06.2018 21:49	EURUSD	Sell	1.16208	1.16176	3.2	6m	0.04%				
18.06.2018 17:48	18.06.2018 18:45	EURUSD	Sell	1.16135	1.16098	3.7	57m	0.04%				
18.06.2018 17:02	18.06.2018 17:28	EURUSD	Sell	1.16078	1.16029	4.9	26m	0.06%				
18.06.2018 16:06	18.06.2018 16:21	EURUSD	Sell	1.16033	1.15991	4.2	15m	0.05%				
18.06.2018 16:07	18.06.2018 16:18	EURUSD	Sell	1.16011	1.15970	4.1	10m	0.05%				
18.06.2018 15:59	18.06.2018 16:15	EURUSD	Sell	1.16051	1.16008	4.3	15m	0.05%				
18.06.2018 15:58	18.06.2018 16:05	EURUSD	Sell	1.16060	1.16020	4.0	7m	0.05%				
18.06.2018 15:55	18.06.2018 15:58	EURUSD	Sell	1.16090	1.16050	4.0	3m	0.05%				
18.06.2018 15:17	18.06.2018 15:58	EURUSD	Sell	1.16168	1.16059	10.9	40m	0.13%				
18.06.2018 14:52	18.06.2018 15:56	EURUSD	Sell	1.16142	1.16066	7.6	1h 4m	0.09%				
									Previous	1	2	Next

Obecnie sprzedaję EU ... 200MA opada na dół, 50 i 10 są do góry więc to są 1C:200 wejścia jakie buduję.

=====

The Anatomy of a Loser



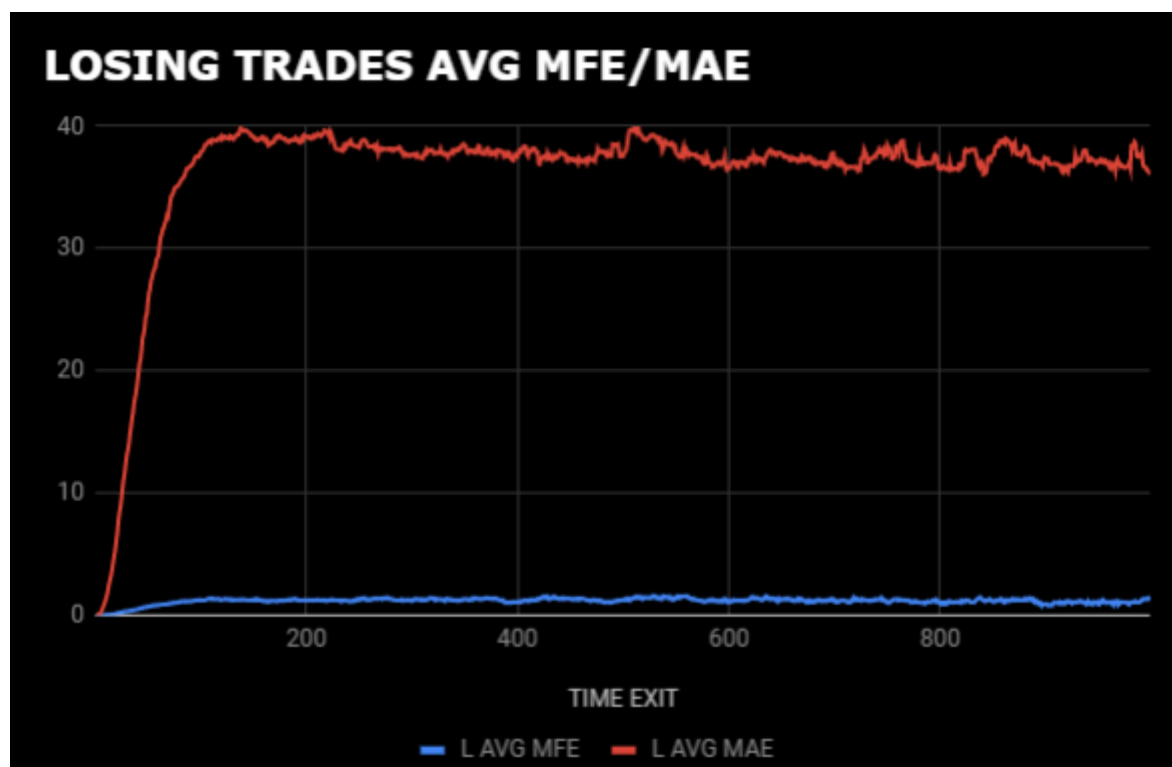
Pojawia się więc to pytanie zadawane regularnie ... „Skąd wiesz, kiedy zamknąć stratę?” To ciężkie pytanie. Skąd możesz wiedzieć, czy nie jesteś zbyt mocno związany z transakcją, w którą, mimo, że jest najprawdopodobniej przegrana, nadal „wlewasz swoje zasoby”? Patrz na dane! Musisz odkryć, wyobrazić sobie jak stratne trejdy się zachowują. Wiedząc jak stratne pozycje się zachowują nie wystarczy, musisz wiedzieć, jak zachowują się zwycięskie trejdy. W ten sposób możesz dokonywać mądrych przewidywań bazując na tym jak bieżący trejd się rozwija w istniejących warunkach. Tak więc, bez dalszych ceregieli, przyglądamy się danym!

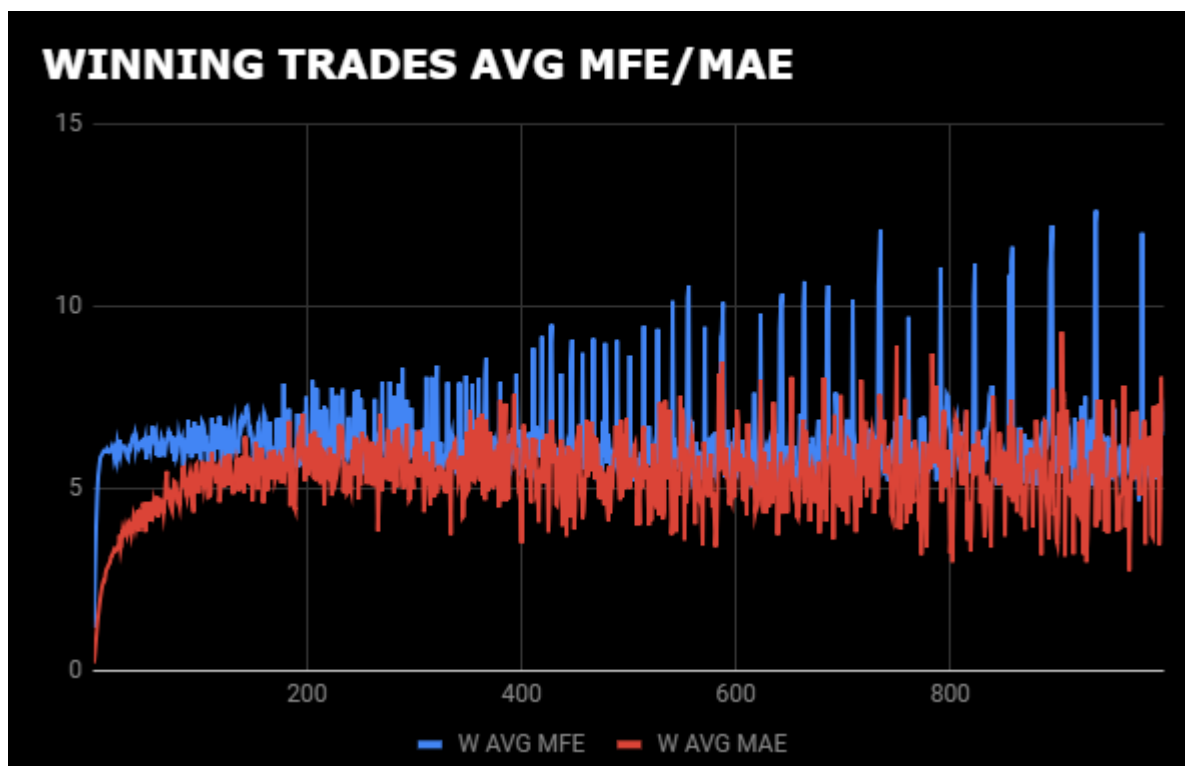
WAŻNA UWAGA:

Są to tylko wartości średnie dla MAE / MFE. Oznacza to, że 50% czasu, w którym MAE będą WIĘKSZE niż średnie. Jeden na 2 będzie większy niż przeciętny ...

Zacznijmy od ogólnego przeglądu tego, jak przegrane i zwycięskie trejdy zachowują się w różnych okresach trzymania po naszym wejściu

Widok z lotu ptaka:





Widzimy wyraźną różnicę w zachowaniach zwycięskich i przegranych pozycji. Jeśli zwycięska zajmie dużo czasu, aby zostać zwycięzcą (100-200 + słupki), średnia wartość MAE pozostanie stosunkowo niska, nawet jeśli utrzymasz pozycję przez tak długi czas. Z drugiej strony, jeśli przegrana jest przegrana, nastąpi to raczej szybko, niezależnie od czasu oczekiwania.

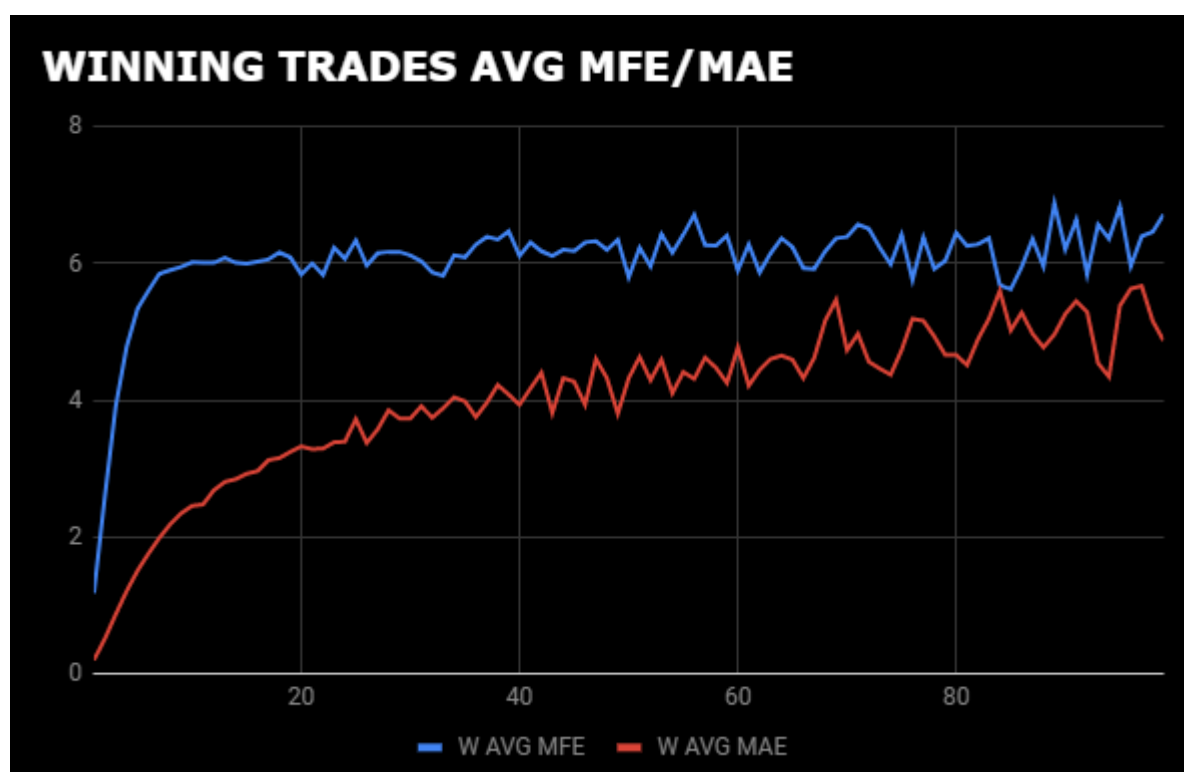
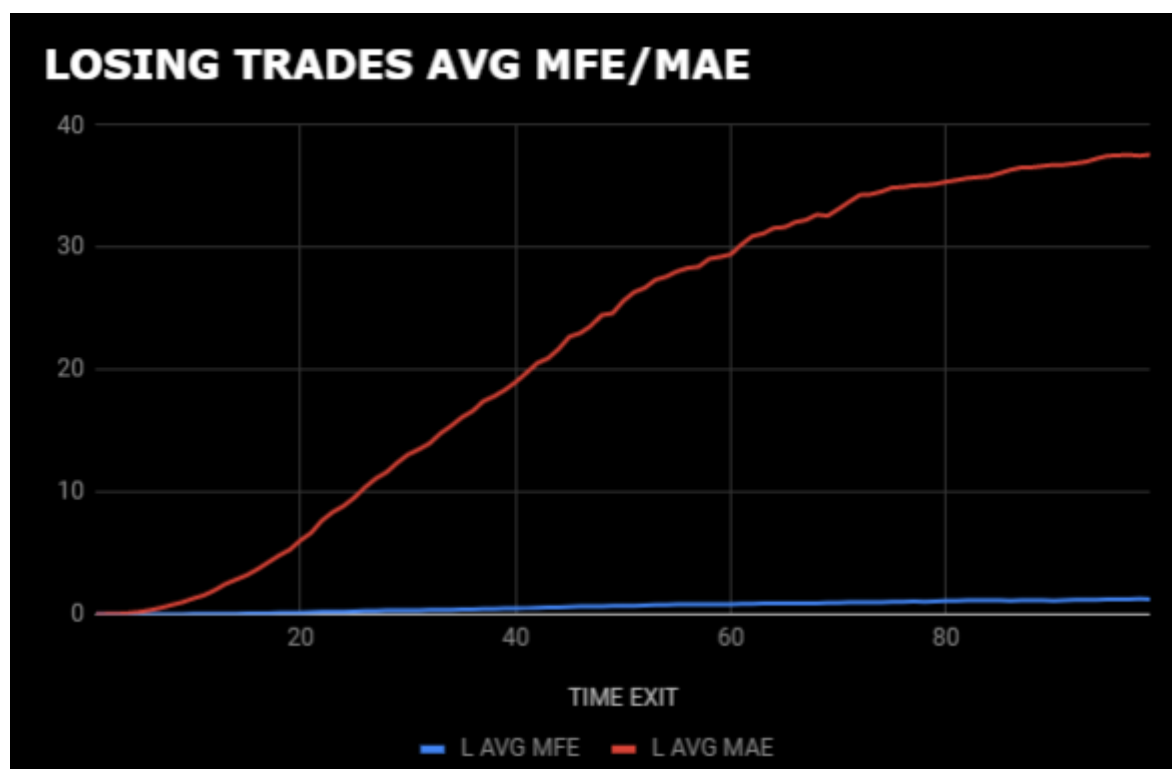
Jeśli utknąłeś w trejdzie na 150 świec, a twoje MAE jak dotąd wynosi 15-20 pipsów lub poniżej Średniego Przegranego MAE, może być bezpieczną konkluzją, że ten trejd w końcu wygra.

Jeśli utknąłeś w trejdzie na 35 świec, a twoje MAE jest już 10-15 pipsów powyżej Średniego Przegranego MAE, bezpieczną konkluzją będzie, że ten trejd przegra, ponieważ ogólnie, jeżeli miałby być zwycięskim, nie byłby w takim głębokim DD, tak we wczesnej fazie trejdu (Zapamiętaj ważną uwagę, nie zawsze będziesz miał rację). Jeśli jednak trejd został zwycięzcą, przeciętnie nie powinien wykazywać tak głębokiego DD nawet jeśli trwał 200 lub więcej świec zanim dotarł do twojego TP.

Główna idea tego wszystkiego zaczyna się, im dłużej jesteś w trejdzie i niższa twoja MAE, tym bardziej prawdopodobnie trejd będzie zwycięski. Z każdą świecą, która zamyka się kiedy twoje MAE pozostaje dobrze poniżej średniego MAE dla tego okresu trzymania trejdu, prawdopodobieństwo że trejd zamknie się zwycięstwem lekko wzrasta (to jest ekstremalnie mało, ale wzrasta). Przeciwnie twierdzenie jest również prawdziwe, jeśli twoje MAE kontynuuje przebywanie powyżej średniego po każdej zamkniętej świecy, będzie oznaczało prawdopodobieństwo tego trejdu, że będzie przegrany pomalutku wzrasta z każdą nową świeczką.

Możemy więc nakreślić kilka wniosków z naszego przeglądu zwycięskich i stratnych trejdów. Zgłębmy trochę teraz W tee wykresy powyżej dokładniej abyśmy mogli sformułować kilka podstawowych ogólnych zasad w jaki sposób moglibyśmy użyć te dane do ograniczania strat.

Winners & Losers – Pierwsze 100 świec po wejściu



Ponownie, zauważ jak Średnie MAE drastycznie pomiędzy zwycięzcami i przegranymi. Przeciętnie, po 20 świeczkach po zajęciu pozycji, twoje średnie MAE mogłoby przejechać 6 pipsów w ciągu 20 świec, jeśli trejd jest przegrany. Jeśli jest zwycięski, to jest przeciętnie 3 pipsy. Teraz, te różnice są bardzo małe na początku jednak jak czas trzymania się wydłuża wzrastają bardzo szybko. Średnio po 40 świecach od wejścia, twoje przeciętne MAE może podążyć do 19 pipsów, jeżeli trejd jest stratny. Jeśli to jest zwycięzca, ta przeciętna to tylko 4 pipsy. Średnio po 60 świecach od wejścia, twoje przeciętne MAE może podążyć do 30 pipsów po 60 świecach o ile trejd jest stratny. Jeśli jest zwycięzcą ta przeciętna wynosi tylko 5 pipsów.

Reguły cięcia strat:

- po 20 świecach od zajęcia pozycji:
 - - Jeżeli twoje MAE osiągnęło więcej niż 3 x średnią, wydaje się, że jesteś w stratnym trejdzie.
 - - Jeśli twoje MAE pozostaje w relatywnie nisko w czasie pierwszych 20 świec, jest szansa, że wygrasz.
- po 40 świecach od zajęcia pozycji:
 - - Jeżeli twoje MAE osiągnęło znacząco więcej niż 19 pipsów, wydaje się, że jesteś w stratnym trejdzie.
 - - Jeśli twoje MAE pozostaje nisko mniej niż 10-15 pipsów w czasie pierwszych 40 świec, jest szansa, że wygrasz.
- po 60 świecach od zajęcia pozycji:
 - - Jeśli twoje MAE jest około 30 pipsów po 60 świecach, wydaje się, że jesteś w stratnym trejdzie.
 - - Jeśli twoje MAE pozostaje nisko mniej niż 10-15 pipsów w czasie pierwszych 60 świec, jest szansa, że wygrasz.
- What to consider while watching the trade develop. Co brać pod uwagę obserwując rozwój trejdu.
 - - Wyobraź sobie, że rysujemy linie MAE na twoim otwartym trejdzie w trakcie jak się rozwija, świeca po świecy. Jak ta linia wygląda budując się świeca po świecy? Jeśli rozwija się jak średnie MAE dla stratnego trejdu I kontynuuje tak przy każdej nowej budującej się świecy, jesteś najprawdopodobniej w stratnym trejdzie. Jeśli rozwija się jak średnie MAE dla naszych zwycięskich trejdów i kontynuuje ten rozwój świeca po świecy, najprawdopodobniej jesteś w zwycięskim trejdzie.

Mam nadzieję, że to da wszystkim możliwość dobrego rozpoznania, kiedy ciąć nasze straty czy zmniejszać wielkość pozycji.

=====

Wolny dzień... Większą część dnia spędziłem w DD dla kilku zleceń w okolicach 1.1570-80.

Trejd wyglądał jak stratny na początku aż MAE poleciało do góry, ale potem spadło i nie kontynuowało spadku jak powinno, czyli stratny, na pewno. Ale potem zdarzyło się że to DD odpłaciło mi się, Wyskrobałem 51pipsów jako że cena odbijała się w 25 pipsowym kanale.

Trade looked like a loser at first as MAE went up quickly but then dropped off and didn't continue how it should have it was a for sure loser.

Trading Activity		Open Trades (12)		Open Orders (0)		History (11)		Exposure		More	
Symbol	Action	Open Price	Close Price	Pips	Duration	Gain					
EURUSD	Sell	1.15843	1.15803	4.0	37m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15878	1.15834	4.4	2h 27m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15924	1.15884	4.0	8m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15870	1.15830	4.0	7m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15811	1.15771	4.0	9m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15757	1.15736	2.1	21m	0.02%					
EURUSD	Sell	1.15779	1.15708	7.1	16m	0.08%					
EURUSD	Sell	1.15752	1.15710	4.2	1m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15812	1.15766	4.6	13m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15751	1.15712	3.9	16h 5m	0.05%					
EURUSD	Sell	1.15803	1.15714	8.9	15h 42m	0.11%					

Przechodząc do moich wejść po 1.1570s-80 wygląda na to, że wyjdę dziś wieczorem w trakcie azjatyckiej sesji. Ogólnie rzecz biorąc, spodziewam się, że UE będzie miała kilka brutalnych dni w najbliższych tygodniach, więc będę nastawiony spadkowo.

Dwie gospodarki i ich wyniki poważnie się różnią, wraz z każdym państwem CB i ich polityką monetarną.

Obserwuj średnie kroczące i nie bądź zszokowany, jeśli zobaczysz mnie jutro, sprzedając więcej euro lol. Zamknąłem resztę moich pozycji w obszarze 1.1570-80 z wcześniej. Dorobiłem także kolejne, dodatkowe 6 pipsów.

?	Symbol	Action	Open Price	Close Price	Pips	Duration	Gain	?	?
	EURUSD	Sell	1.15733	1.15671	6.2	34m	0.07%		
	EURUSD	Sell	1.15730	1.15639	9.1	11h 14m	0.11%		
	EURUSD	Sell	1.15713	1.15638	7.5	13h 36m	0.09%		
	EURUSD	Sell	1.15679	1.15638	4.1	11h 17m	0.05%		
	EURUSD	Sell	1.15686	1.15645	4.1	11h 18m	0.05%		
	EURUSD	Sell	1.15694	1.15649	4.5	11h 19m	0.05%		
	EURUSD	Sell	1.15786	1.15651	13.5	10h 10m	0.16%		
	EURUSD	Sell	1.15729	1.15656	7.3	10h 44m	0.09%		

=====

Nie lubisz R:R? Odsuś sobie to doskonale!

Tak szybko jak tylko sis opublikuje odwrotny R:R



4 pipsy TP I 36 pipsów SL!? SIS TY GŁUPCZE! TO NIGDY SIĘ NIE UDA! NIE WIESZ, ŻE WIELKOŚĆ R:R TO TWOJA PRZEWAGA!? Chodzi mi o to, że wszyscy Uber mówią, że nigdy nie powinienem używać poniżej 1: 3 ... i nie zarobiłem żadnych pieniędzy z naśladować ich, więc wiesz, że to prawda! Nigdy też nie widziałem żadnych danych nic takiego podobnego, aby wytłumaczyć dlaczego ten jest lepszy od drugiego, lub jeżeli w ogóle są jakieś różnice czemu to robisz!?

Wiedziałem że to się wydarzy ...

Nawet jakby miało przyjść z odległości 1000 czy 2000 mil.

Ok,
Poukładajmy to jak należy.

Nie lubisz R:R? Dobra, odsuś tę wspaniałość i używaj cokolwiek chcesz, przewaga na wejściu pozostanie taka sama, jedynie twoja wprawa i technika będzie twoim MM które będą miały największy wpływ. Nie wierzysz mi? Spójrz poniżej:

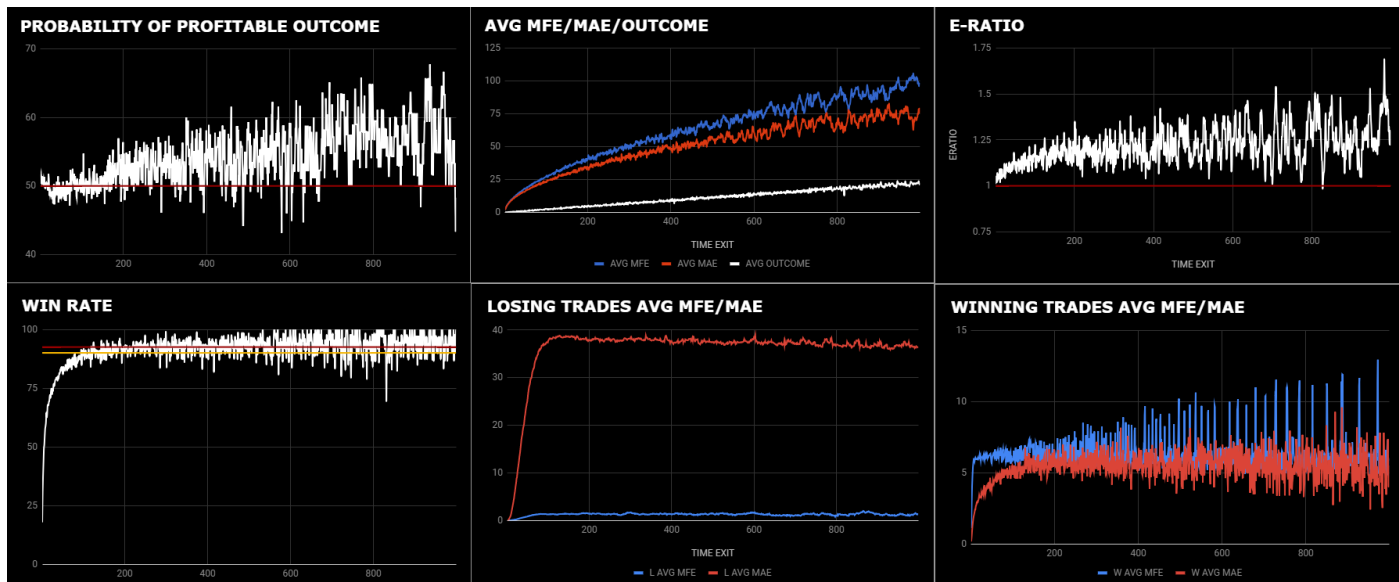
Jeśli śledziłeś moją pracę przez długi czas, możesz pamiętać pierwszy wątek, jaki kiedykolwiek napisałem o cenie podróżującej między pivotami, bez żadnego wymogu czasu, aby zobaczyć, jak prawdopodobna cena będzie się odbijać się od jednego do drugiego. Ostatecznie dane doprowadziły mnie do takiego wniosku. Jeśli losowo wejdiesz na rynek, bez względu na to, z jakiego r: r użyjesz, twoje win rate będzie równa progowi rentowności tej konfiguracji R:R minus koszty handlowe.

Z tego możesz wywnioskować, że są tylko 2 rzeczy, które naprawdę mogą nam dać przewagę:

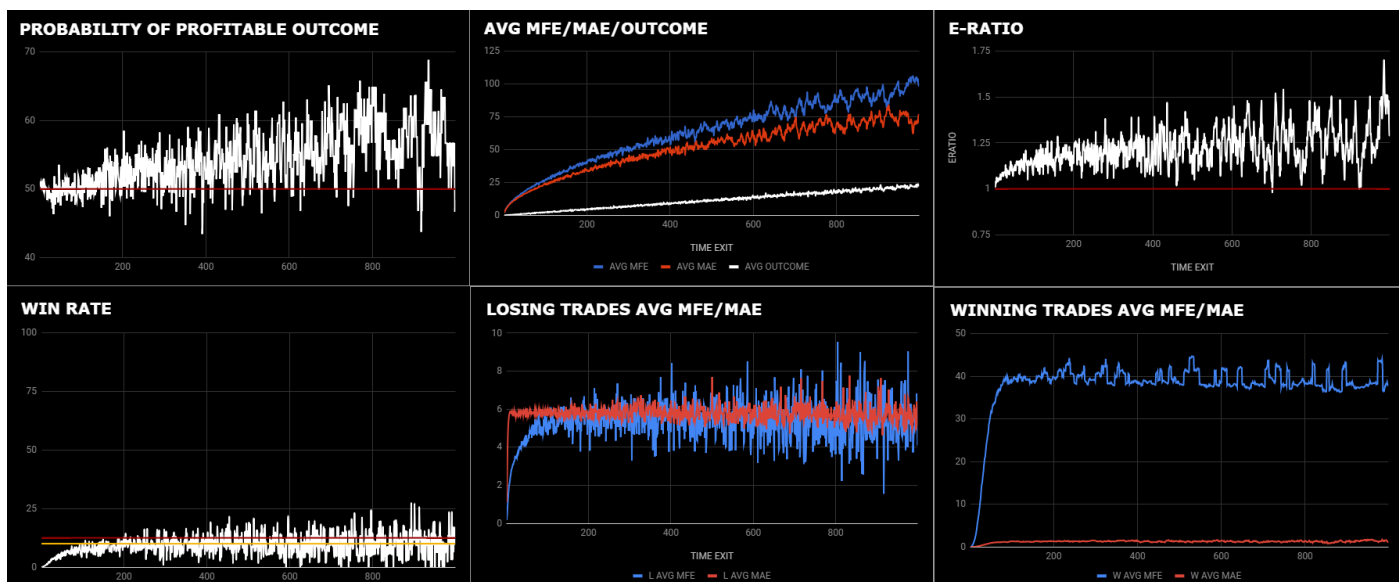
1. Posiadanie przewagi na bazie wejścia, bez znaczenia zakładanego R:R
2. Identyfikowanie winerów i looserów abyś mógł wiedzieć które trejdy ciąć a które zastawiać.

Jaki widać różnice pomiędzy tymi dwoma wykresami?
(All images below use the 3C:200-50-10 entry)

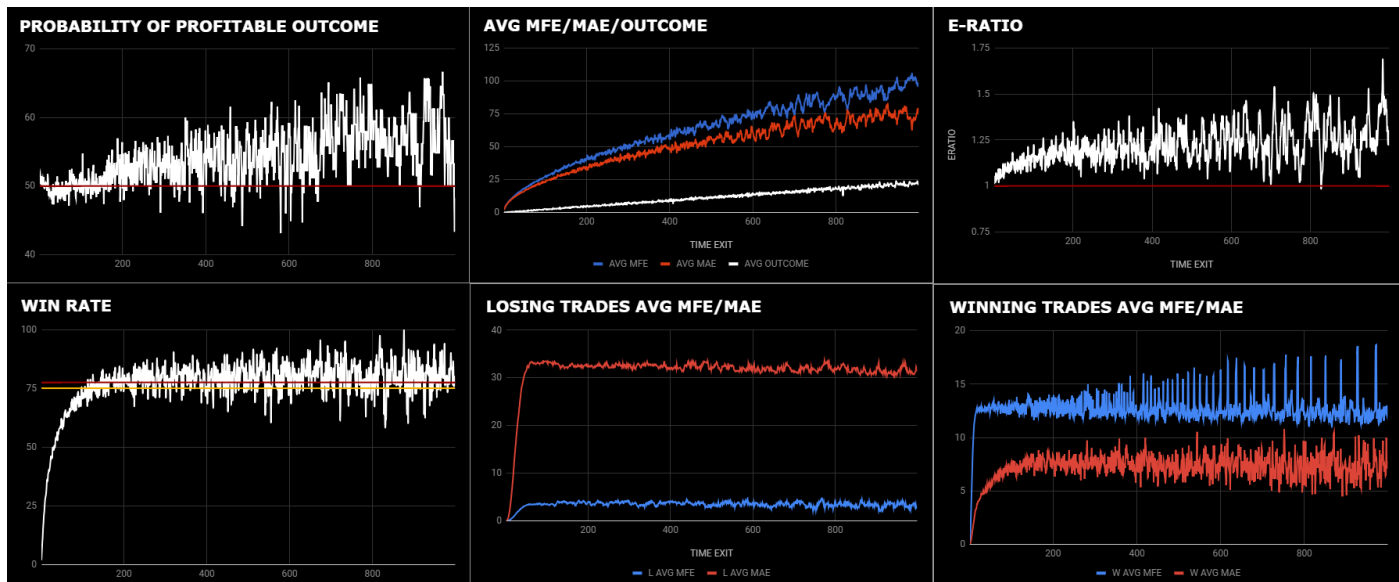
36 Pip SL - 4 Pip TP



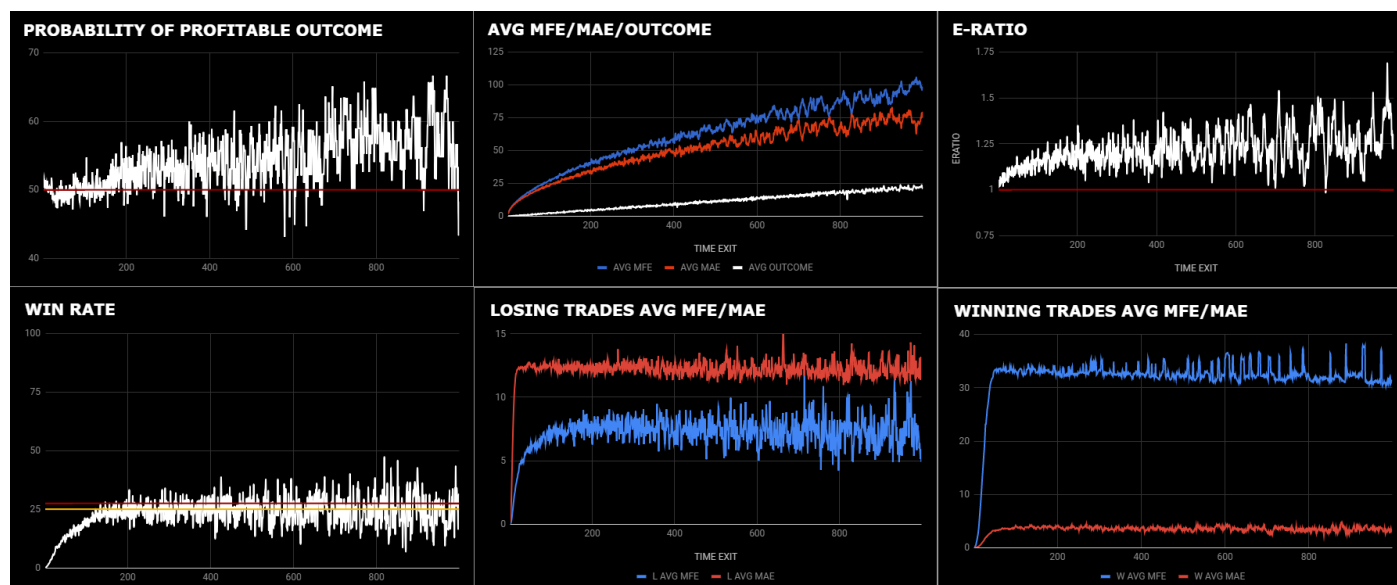
4 Pip SL - 36 Pip TP



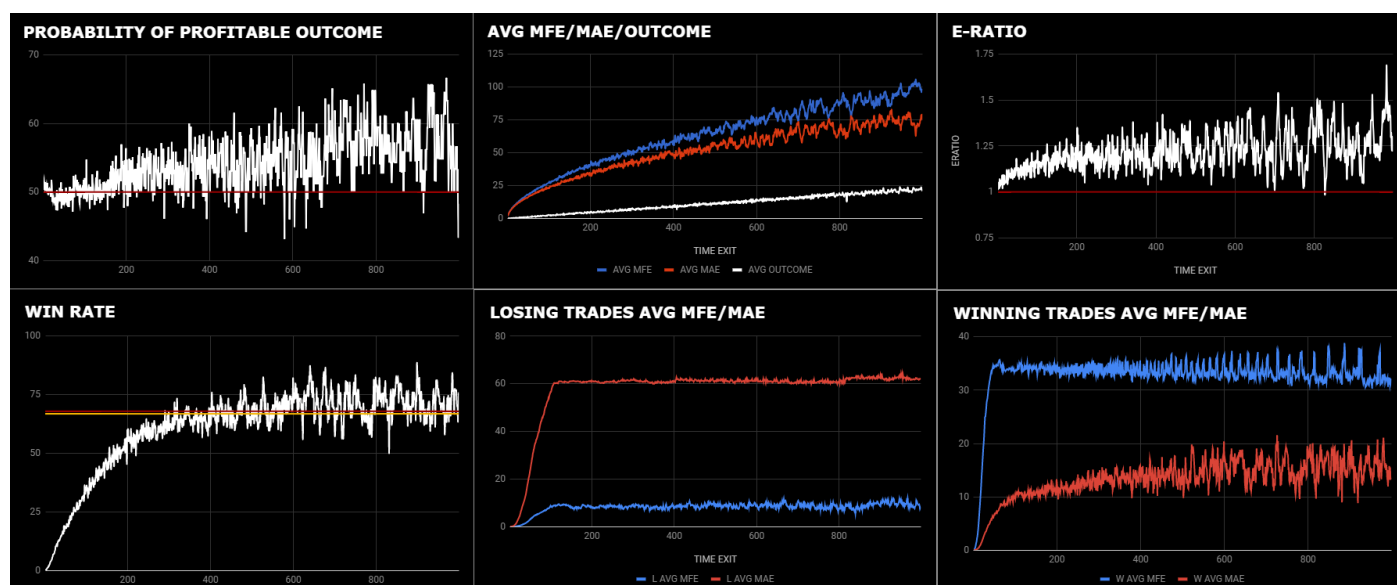
A te dwa? 30 Pip SL - 10 Pip TP



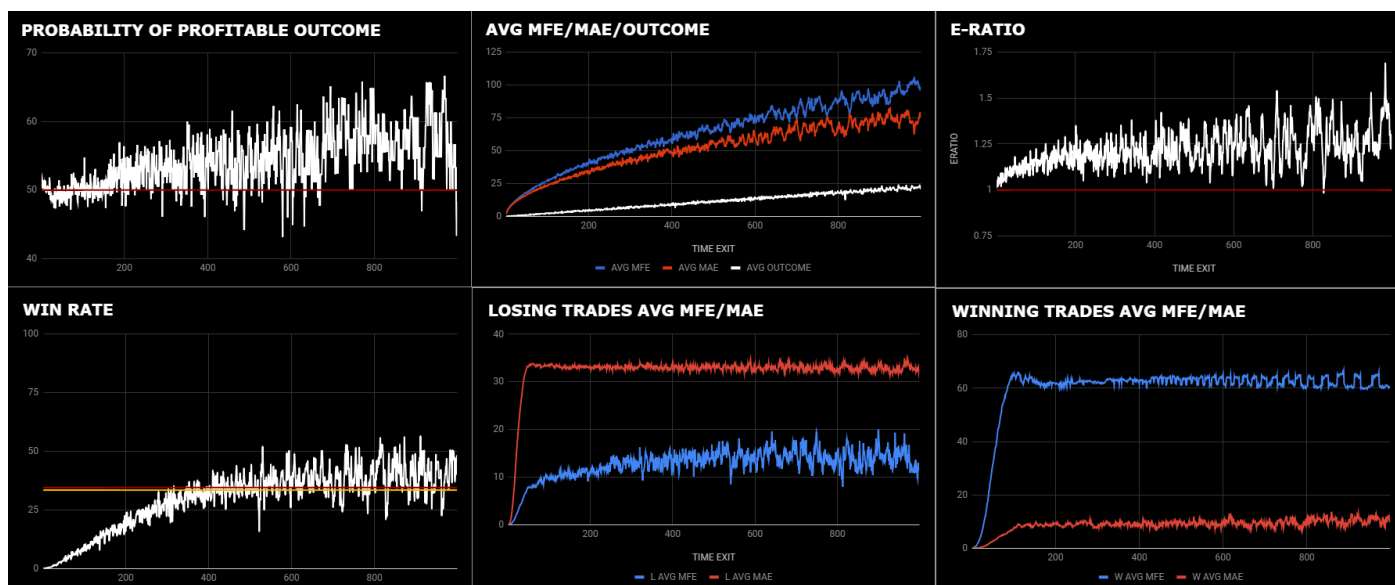
10 Pip SL - 30 Pip TP



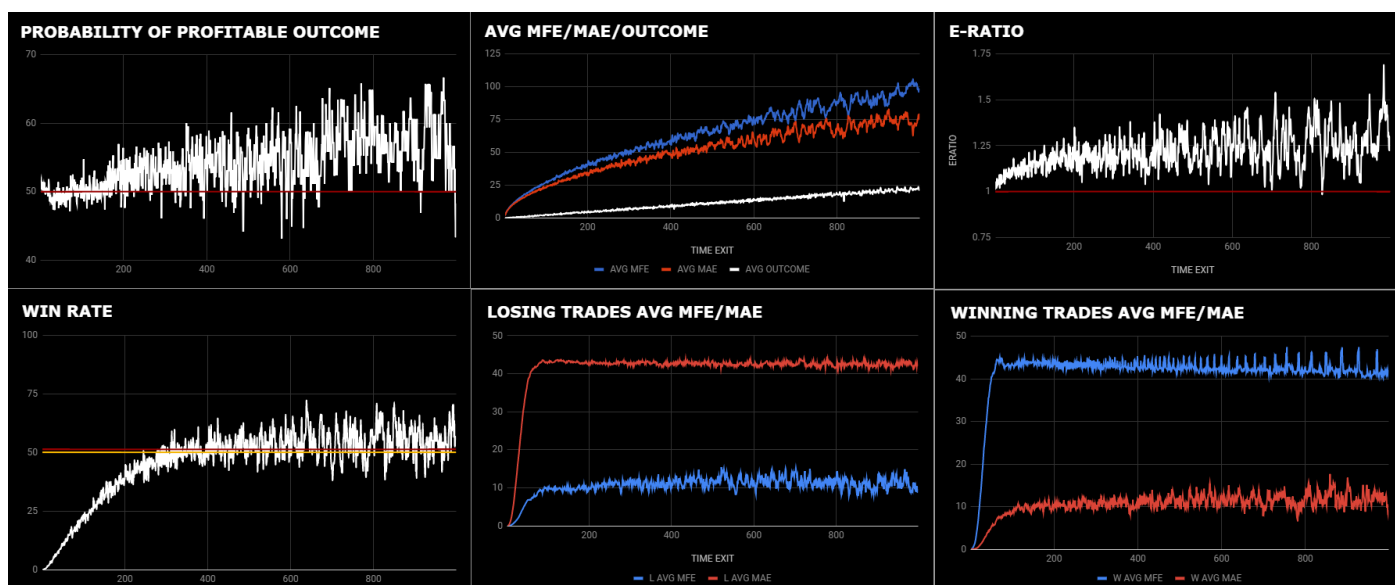
A co z tymi dwoma?? 60 Pip SL - 30 Pip TP



30 Pip SL - 60 Pip TP



Wrzućmy wykres 1:1 dla zabawy 😊 40 Pip SL - 40 Pip TP



Czy zmieniła się twoja przewaga w czasie zajmowania pozycji?

Nie.

Jedynie rzeczy które ulegają zmianie to:

- Wielkość twoich zwycięskich trejdów czy stratnych trejdów
- Dystrybucja twoich zwycięskich trejdów czy stratnych trejdów
- Sposób w jaki zarządzasz trejdem.

Twoja przewaga pozostaje taka sama... Ponieważ przewaga powstaje podczas wejścia I jest tym co determinuje twoje wyniki bez znaczenia używanego R:R (zakładając, że używasz rozsądne wielkość, 1000 pipsów TP wydaje się trochę za dużo...). Możesz wzmocnić swoją przewagę z wejścia tym jak zarządzasz trejdem.

Więc jeżeli nie lubisz R:R jakiego ja używam, używaj taki jaki ci pasuje. Ja osobiście lubię wygrywać, więc preferuję wysoki stosunek wygranych do przegranych. Jeżeli nie przeszkadza ci branie ton małych strat dla kilku dużych winnerów, proszę bardzo przełącz się 2:1 czy 1:2 lub 1:0.3238843 czy 0.832323:16 lub jakkolwiek do diabła chcesz!

Jeżeli jesteś stosunkowo nowy lub nie trejdowałeś dłuższy okres czasu a czujesz się wspaniale na rynku, myślę że

było by głupio używać R:R kiedy spodziewasz się przegrywać więcej niż 30% czasu. Powtórzę ponownie, że to nie obchodzi nikogo, ale większość stworzeń w naturze swojej przestanie współzawodniczyć i przestanie grać, jeżeli tracą więcej niż 30% czasu. Przeważnie są psychicznie pokonani.

<https://youtu.be/5cTyxJWZC7k>

Jakiegolwiek R:R sobie wprowadzisz, musisz zrozumieć że R:R nie daje żadnej wzmocnienia w kwestii pozyskania przewagi. Wszystko co może to zmienić sposób w jaki zarządzasz swoimi wygranymi i przegranymi, dystrybucję twoich wygranych i przegranych.

Jak możesz mówić, że 1C-10: Cena zamyka się powyżej średniej kroczącej 10 i średnia idzie do góry ma szanse że twój TP zostanie osiągnięty 90% przypadków? Załadowałem twój wskaźnik i potestowałem trochę i szczerze mówiąc nie widzę żadnej zyskowności. Możesz to lepiej wyjaśnić? Dziękuję.

See important notes... Przeczytaj "Ważne Uwagi"

90% zbiega się z czasem wstrzymania ...

Po prostu używając R:R 36:4 masz 90% BE ... tak więc bez przewagi nie będziesz wygrywał 90% czasu z takim R:R ... Z przewagą I dobrym zarządzaniem możesz osiągnąć 93% i więcej.

Czasami zastanawiam się, dlaczego dzielę się, tak dużo pokazuję ... Zawsze myślę, że wielka szkoda że nikt mnie nie udostępnił tej wiedzy, jako że nie jest jakaś specjalnie skomplikowana wiedza, albo po prostu ja czuję, że jest taka, kiedy sam dokładnie wszystko rozumiałem. Innym powodem, dla którego to piszę i udostępniam jest przekonanie, że ludzie właściwie nie będą tego czytać lub próbować się nauczyć.

Zgadzam się I nie zgadzam z wami w kwestii manipulowania stadami. Niektóre statystyki, mogą być manipulowane, ale te statystyki nie zapłacą rachunków i w większości wypadków manipulowanie udowadnia manipulantom, że nie może zapłacić rachunków.

Kasa jaką wyciągasz każdego tygodnia I kasa z jaką zaczynasz początek tygodnia nie może być zmanipulowana. Twój zysk nie może być zmanipulowany.

Dla mnie, to są rzeczy które mają znaczenie w każdej strategii:

1. Wielkość spreadu w stosunku do całkowitej wielkości pomiędzy twoim średnim TP i SL (o ile są zmienne w każdym trejdzie)
 2. Przewaga jaką daje wejście i jego konsystencja w czasie.
 3. Spodziewana wartość z przewagi wejścia połączona z zarządzaniem parametrami ryzyka i kosztów trejdu.
 3. The expected value from the entry edge combined with the risk management parameters and trading costs.
- Dobre?

More Data For Better Decision Making



(Gdyby tylko wiedziała, że butelka była przed chwilą wstrząśnięta)

Tak więc przejrzelśmy anatomie Hilary Clinton która okazała się brudna do spodu. Pokazuje to nam jak nasze zwycięskie i stratne trejdy powinny się zachowywać w miarę upływu czasu od zajęcia pozycji dając rozsądne powody, kiedy oby go wyciąć a kiedy pozwolić mu biec zwiększając nawet jego wielkość.

To znakomite informacje prowadzące nas po tym jak zajęliśmy pozycję na rynku, ale widzimy ciągle wiele pytań dotyczących KIEDY zająć pozycję na rynku z racji że zasady zajmowania pozycji na rynku są bardzo szerokie. Mamy co najmniej 7 sygnałów wejściowych ważnych na niemalże na zamknięciu każdej kolejnej świecy i zazwyczaj więcej niż jeden facet (Co do cholery ten facet tu wypisuje, siedem durnych wejść które niemal zawsze są spełnione? Przyciskanie klawisza enter nie wystarczy! Wycieranie nosa nie może być łatwiejsze niż zarabianie na życie!)

No dobra, nie mam zamiaru pokazywać, że zarabianie jest łatwiejsze niż wycieranie nosa, ale chciałbym pokazać jak używać dane, aby dokonywać lepszych decyzji dla zdeterminowania momentu wejścia w trejd.

Średnie i ich nachylenie jakie używamy do podawania nam sygnałów posiadających przewagę, ale również przekrajają nam rynek w cykle! Cykl niedźwiedzi zaczyna się, kiedy cena otwiera się powyżej średniej kroczącej i zamyka się pod nią, a kończy się gdy sytuacja jest odwrotna, kiedy zaczyna się cykl byka.

Obserwując, jak cena wykonuje cykle z jeden strony średniej kroczącej na drugą, możemy wyrobić sobie zdanie o tym jak daleko w cyklu cena powędruje i jak długo w cyklu pozostanie. Nie potrzeba geniusza aby dowiedzieć się że jeżeli cykl trwa 10 świec, najprawdopodobniej nie chcesz wejść w rynek na dziewiątej świecy jeśli sześć świec przeciętnie potrzeba aby osiągnąć swój cel.

Sprawdźmy więc jak cykle ceny zachowują się wokół naszych trzech różnych średnich kroczących:

```
---Time Cycles (10 MA)---
50% of Cycles Last 3 Candles.
75% of Cycles Last 8 Candles.

---Price Cycles (10 MA)---
50% of Cycles Travel 7 Pips.
75% of Cycles Travel 13 Pips.

---Time Cycles (50 MA)---
50% of Cycles Last 4 Candles.
75% of Cycles Last 15 Candles.

---Price Cycles (50 MA)---
50% of Cycles Travel 8 Pips.
75% of Cycles Travel 19 Pips.

---Time Cycles (200 MA)---
50% of Cycles Last 4 Candles.
75% of Cycles Last 20 Candles.

---Price Cycles (200 MA)---
50% of Cycles Travel 10 Pips.
75% of Cycles Travel 30 Pips.
```

Jak rozumieć dane:

Jeśli cena przebija średnią kroczącą 10, przechodzi ≤ 13 pipsów 75% czasu i przejdzie ≤ 7 pipsów 50% czasu. Kiedy przejdzie już 7 pipsów ma teraz 50% szansy przejścia 6 pipsów więcej aż do 13 pipsów powyżej początku cyklu.

Jeżeli cena przebija średnią kroczącą 10, przechodzi ≤ 8 świeczek 75% czasu i ≤ 3 świeczek w 50% czasu. Kiedy cykl trwa już 3 świece, jest 50% szansy, że będzie trwał jeszcze 5 świeczek więcej sumując się w osiem.

Jeśli cena przebija średnią kroczącą 50, przechodzi ≤ 19 pipsów 75% czasu i przejdzie ≤ 8 pipsów 50% czasu. Kiedy przejdzie już 8 pipsów ma teraz 50% szansy przejścia 11 pipsów więcej aż do 19 pipsów powyżej początku cyklu.

Jeżeli cena przebija średnią kroczącą 50, przechodzi ≤ 15 świeczek 75% czasu i ≤ 4 świeczek w 50% czasu. Kiedy cykl trwa już 4 świece, jest 50% szansy, że będzie trwał jeszcze 11 świeczek więcej sumując się w 15.

Jeśli cena przebija średnią kroczącą 200, przechodzi ≤ 30 pipsów 75% czasu i przejdzie ≤ 10 pipsów 50%

czasu. Kiedy przejdzie już 10 pipsów ma teraz 50% szansy przejścia 20 pipsów więcej aż do 30 pipsów powyżej początku cyklu.

Jeżeli cena przebija średnią kroczącą 200, przechodzi ≤ 20 świeczek 75% czasu i, ≤ 4 świeczek w 50% czasu. Kiedy cykl trwa już 4 świece, jest 50% szansy, że będzie trwał jeszcze 16 świeczek więcej sumując się w 20.

Reguły kiedy Trejdować:

- Jeżeli dystans do twojego TP jest większy niż cykl ma 50% szansy na przemieszczenie się, nie zajmuj pozycji.
- Jeżeli dystans do twojego TP jest mniejszy niż co cykl ma 50% szansy na przemieszczenie się ALE nie dająca trejdowi wystarczająco wystarczającej ilości świec, aby osiągnąć cel (Cykl jest najprawdopodobniej się kończy niż kontynuuje), nie zajmuj pozycji lub zamknij, jeżeli już przebywał w cyklu, bo jest bardziej prawdopodobne zakończenie niż kontynuacja

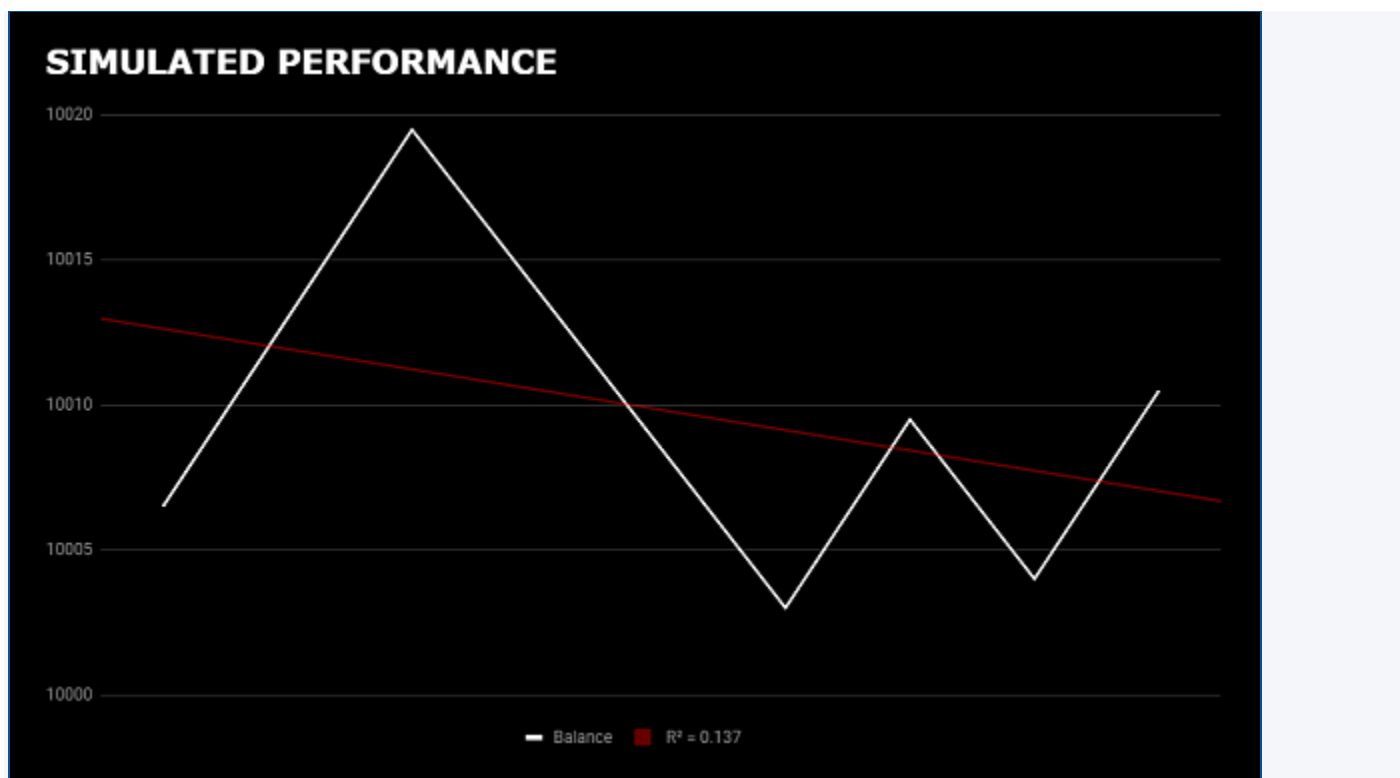
Te odległości w pipsach mierzy się od zamknięcia pierwszej świecy cyklu, do maksymalnego MFE, nie średniej kroczącej do max MFE. To wszystko. Mam nadzieję, że to pomoże, ale jestem pewien, że tak nie będzie.

Equity Progression

Czy zastanawiałeś się, jak wyglądałby twój wzrost konta, gdybyś miał zarabiający system? Założę się, że wyobrażasz sobie, że szedłby prosto, gładko żeglując w kierunku luksusu ... Jestem niemal pewien, że nie wyobrażasz sobie, jak naprawdę to wygląda.

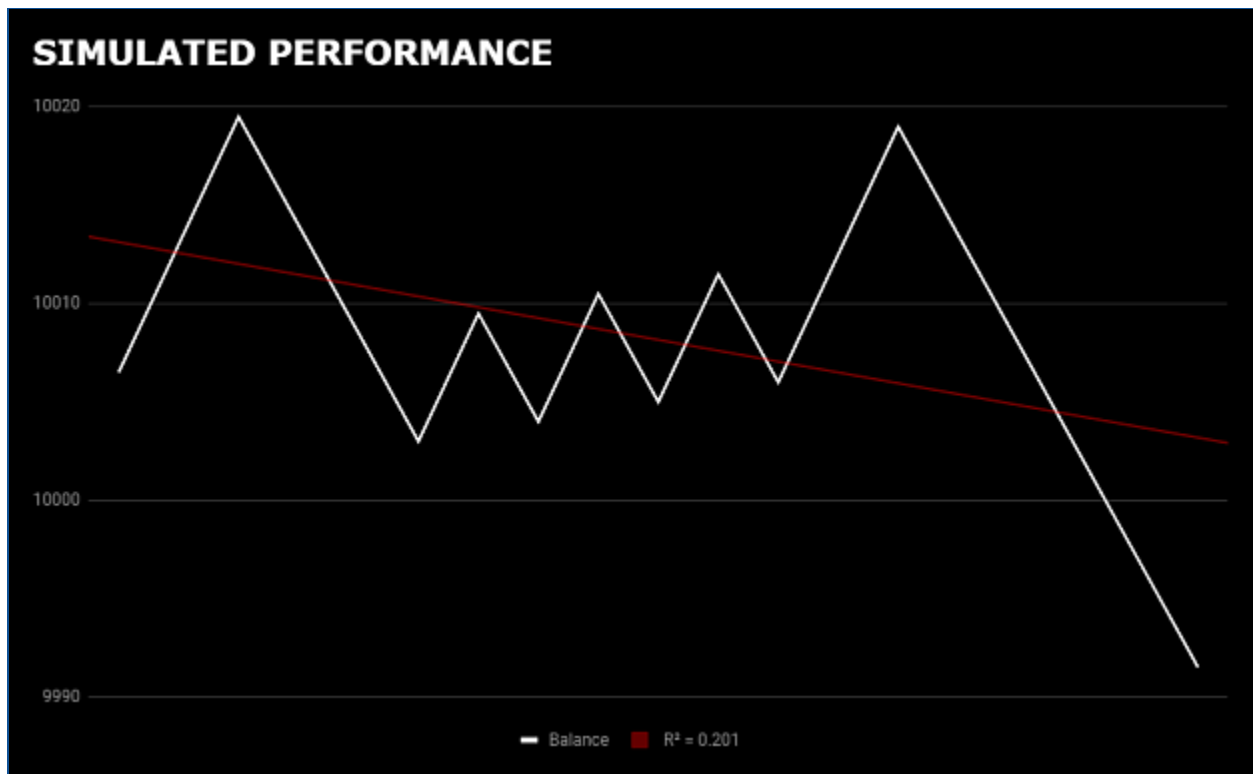
Poniżej przedstawiamy, w jaki sposób Twój kapitał własny rozwijałby się przy użyciu naprawdę silnego systemu po x ilości transakcji. Ta symulacja wykorzystuje system, który ryzykuje 5 jednostek dla 7 jednostek z win rate 50% i spreadem 0,5 pipsa.

10 Trejdów:



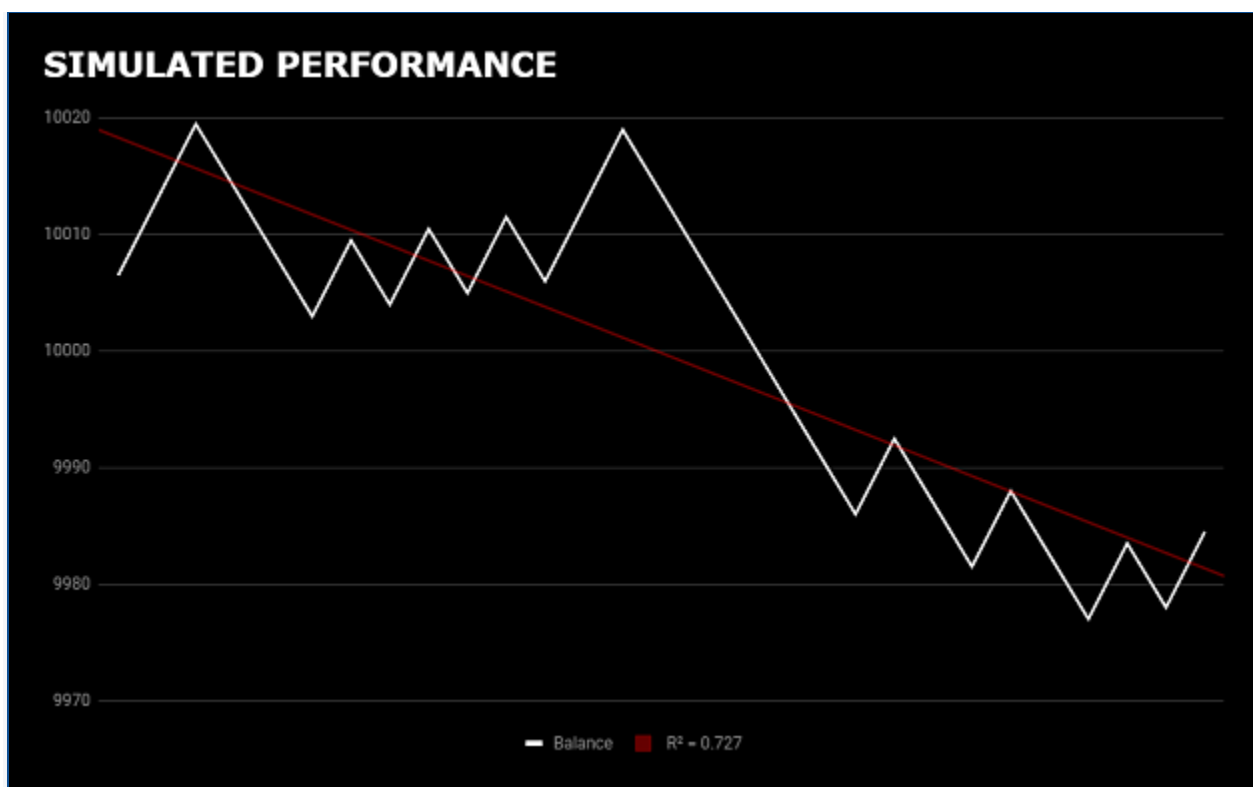
Jak wielu z was kontynuowałoby trejdowanie po 10 trejdach? Dodajmy kolejne 10 trejdów...

20 Trejdó5.:



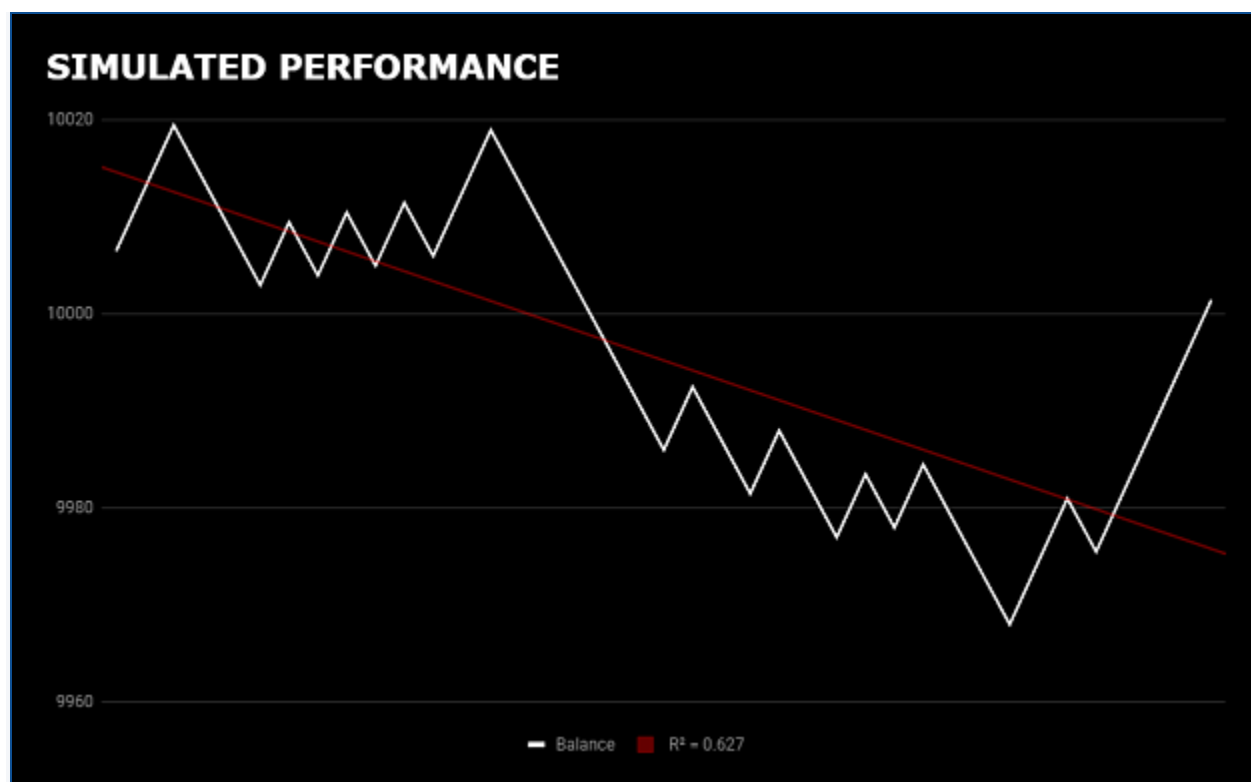
Ilu z was trejdowałoby dalej po tych następnych 10 trejdach? A co z następnymi 10-cioma trejdami?

30 Trejdów:



Ilu z was trejdowałoby dalej po tych następnych 10 trejdach? A co z następnymi 10-cioma trejdami?

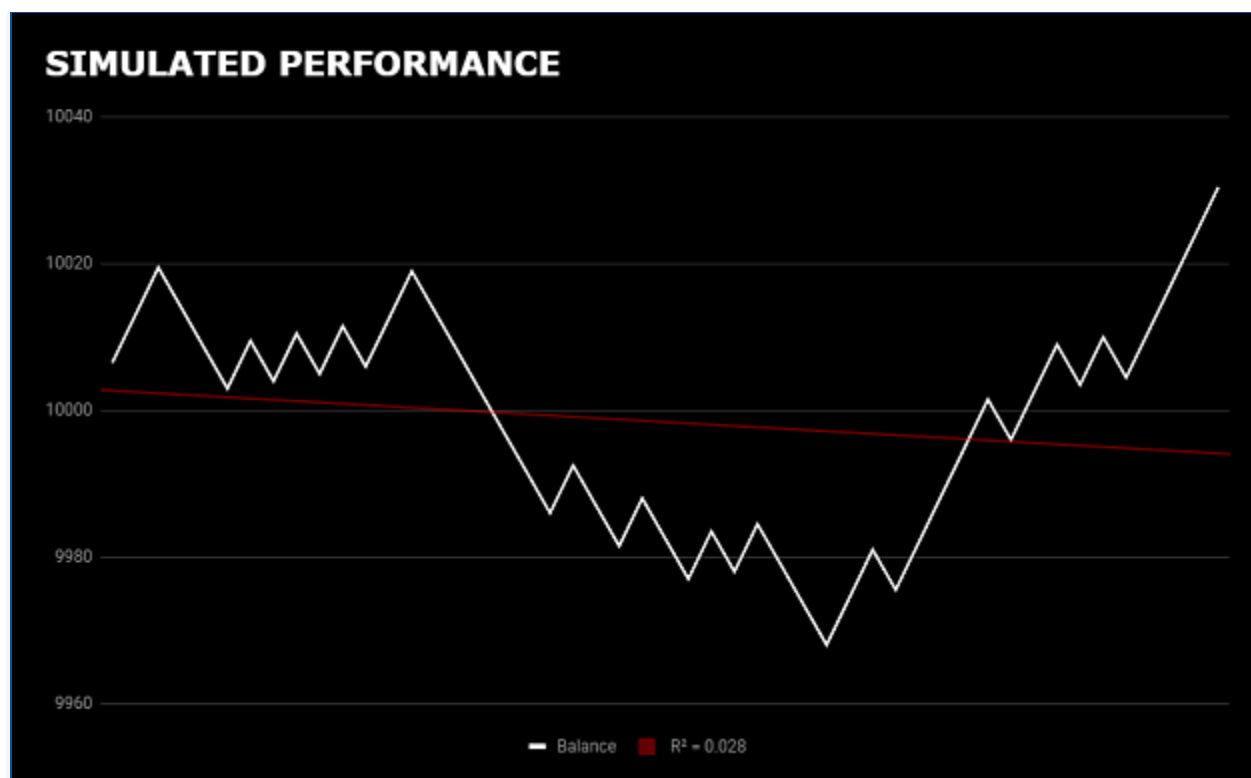
40 Trejdów:



Ilu z was trejdowałoby dalej po tych następnych 10 trejdach? "This thing has to be break even at best!" - Most would say... "Ten system daje najwyżej BE!" Większość z was powiedziałaby.

A gdyby jeszcze 10 trejdów?

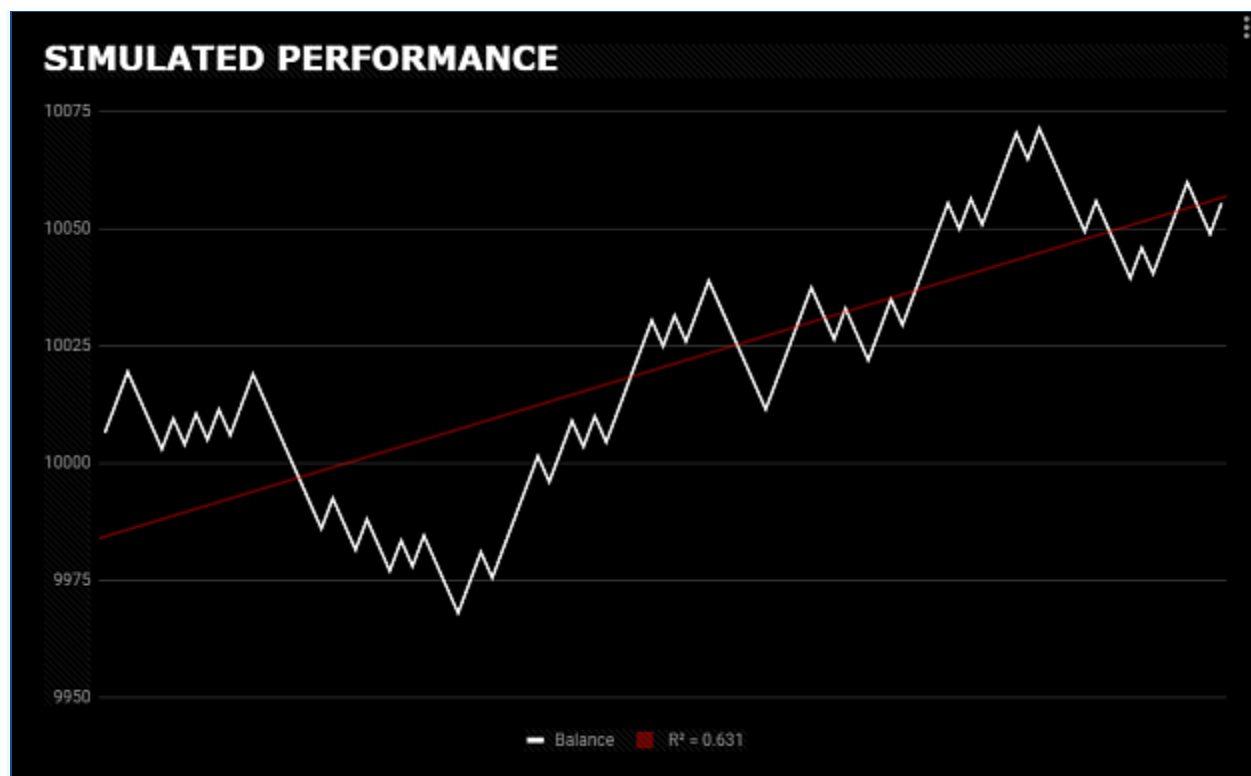
50 Trejdów:



Ach, teraz widzimy coś, co jest co najmniej w pewnym stopniu opłacalne. Ale zajęło 50 transakcji tylko po to, aby

odzyskać kapitał własny, który został stracony w pierwszych 10 transakcjach ... Czy ten system naprawdę ma przewagę? A może jeszcze 50 trejdów więcej?

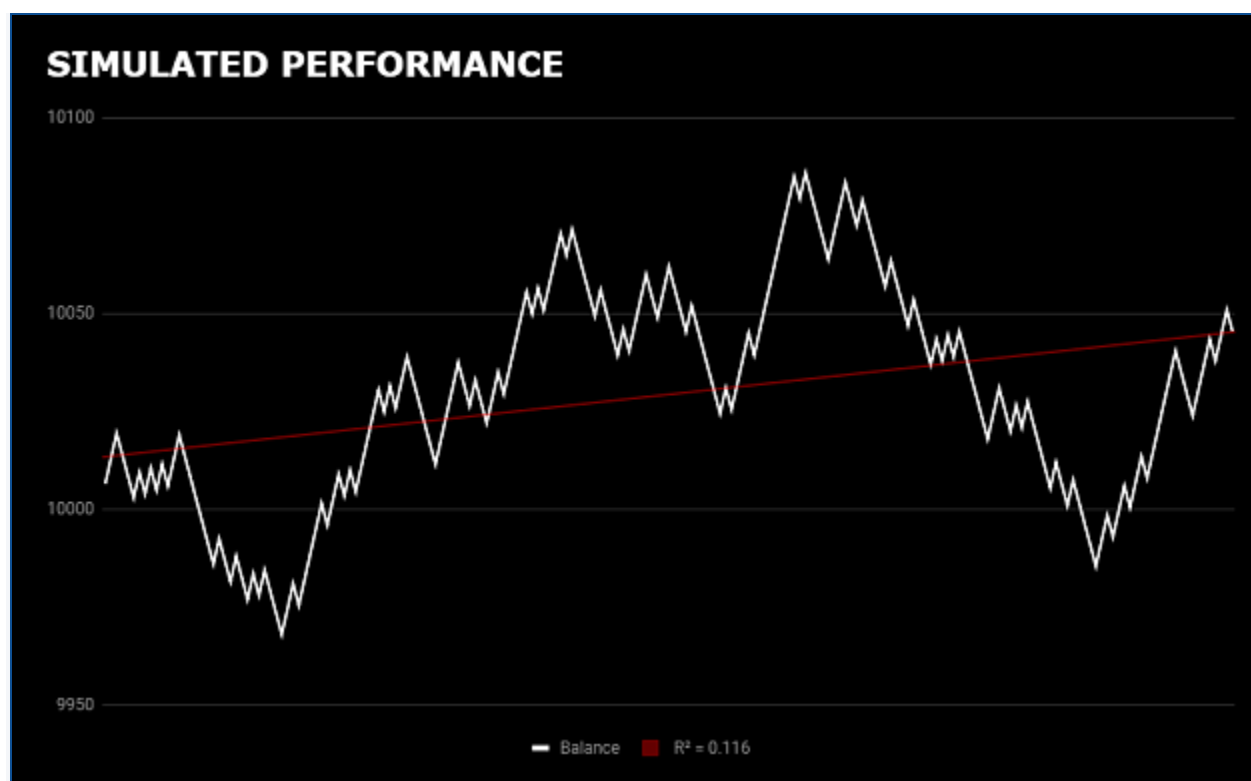
100 Trejdów:



Teraz wygląda całkiem dobrze. Przewaga jest rzeczywisty! LUKSUS JUŻ JEST ZA ROGIEM!

Sprawdźmy kolejne 100 trejdów...

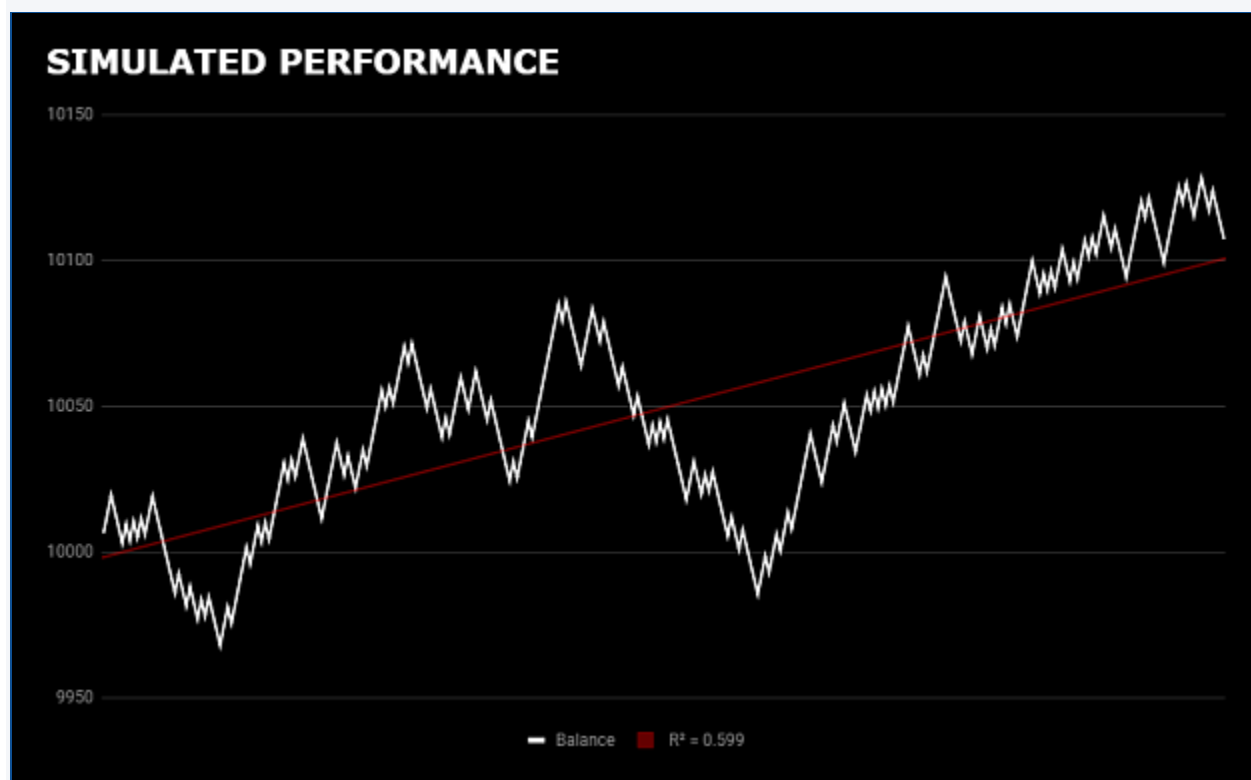
200 Trejdów:



Człowieku w końcu nie wiem, wygląda trochę poharatane. Czy aby na pewno system ma przewagę? Sprawdzmy

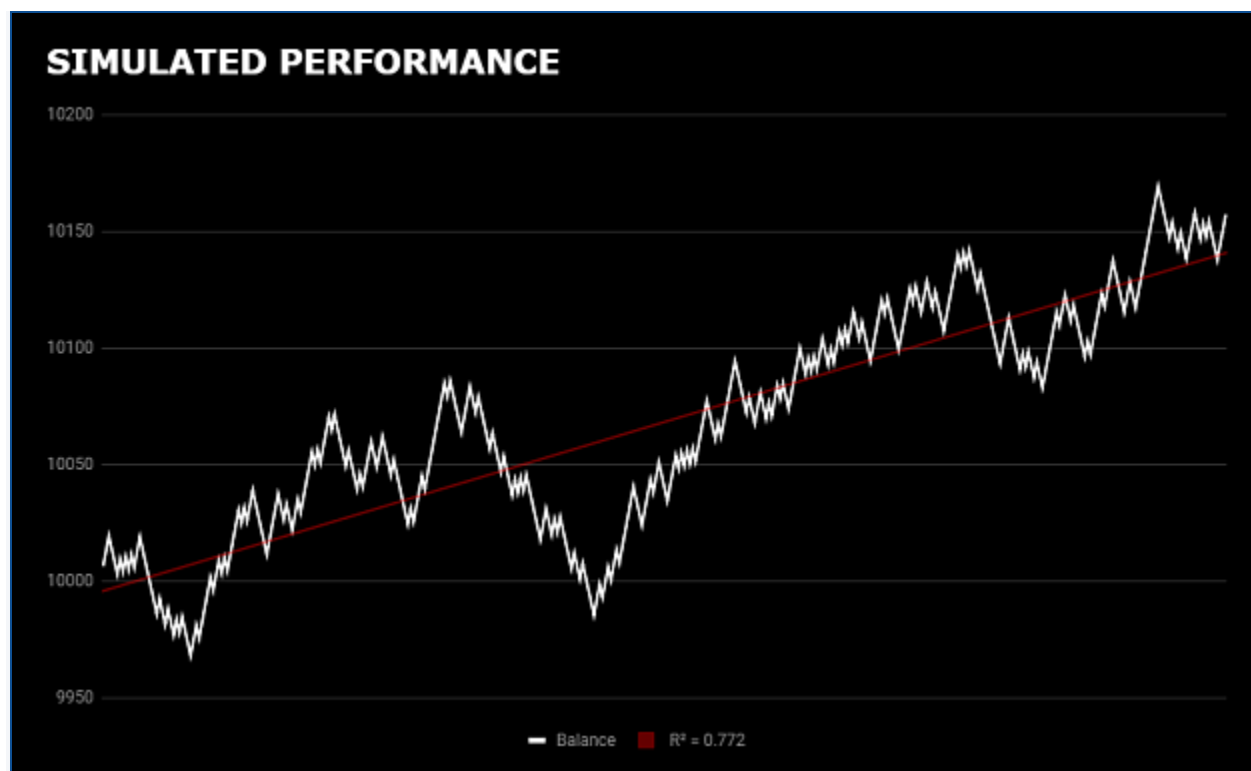
kolejne 100 trejdów.

300 Trejdów:



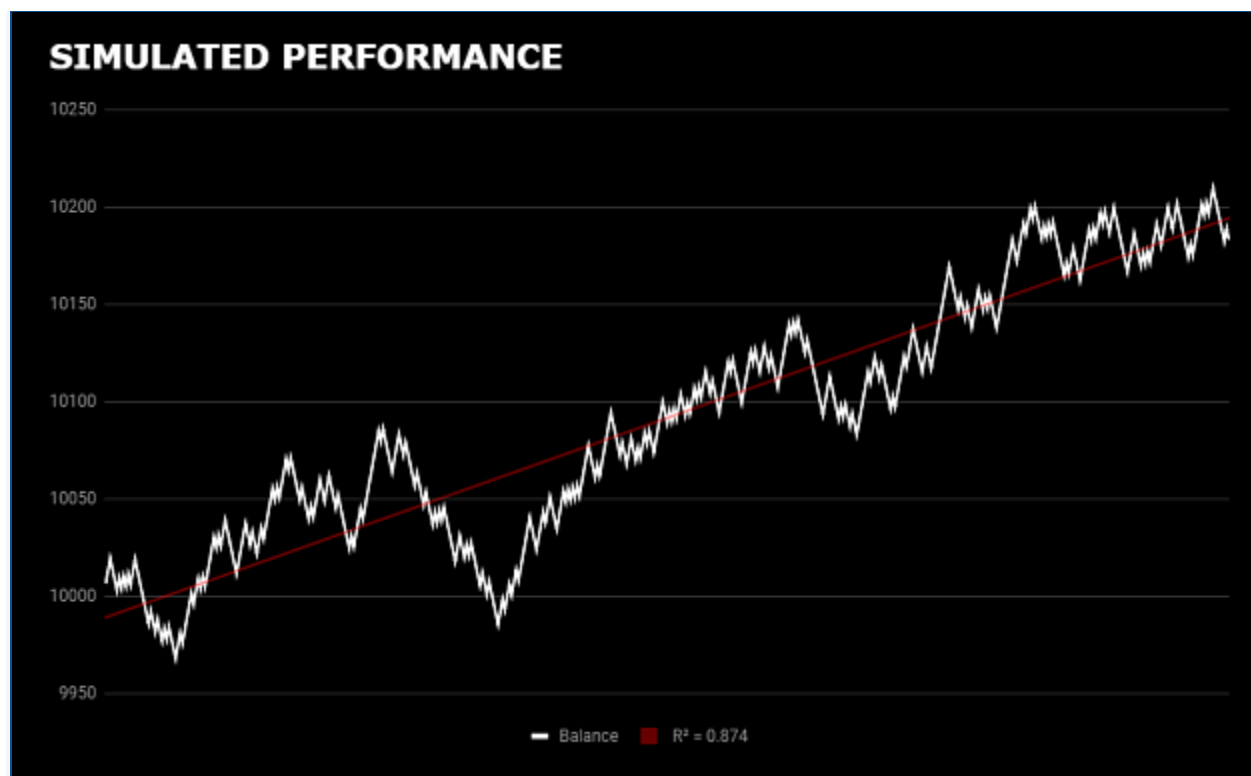
O yeah! Things are looking good again, let's do 100 more. OK, teraz wygląda znowu dobrze, sprawdźmy kolejne 100 trejdów

400 Trejdów:



O tak, Wspinamy się, co po kolejnych 100 trejdach?

500 Trejdów:



Myślę, że można bezpiecznie stwierdzić, że przewaga istnieje

Ćwiczenie:

Wyobraź sobie, że każdy wykres jest wykresem twojej krzywej wzrostu kapitału.

Ilu z was prowadziłyby dalej testowanie po wynikach tej pierwszej dziesiątki?

A po wynikach pierwszych dwudziestu trejdów?

Jak wielu z was próbowałoby coś zmieniać po pierwszych 40 trejdach?

Jak wielu z was byłoby zdolnych zaufać systemowi i nie zmieniać niczego po pierwszych stu, dwustu czy trzystu trejdów?

Odpowiedź, niewielu. Dlaczego się tak dzieje?

Powiedziałbym, że to mieszanina braku przekonania do system i brak zrozumienia dla centralnego twierdzenia granicznego i prawa liczb wielkich ... no ale to moje zdanie.

Prawdopodobieństwo Zysku a Seria

Nowy trejder testuje nowy zyskowny system, Zrobił już 500 trejdów w czasie kilku tygodni czy miesięcy. Ciągłe jednak traci.



W tym ostatnim poście przyjrzeliśmy się, jak nasza krzywa kapitału może się rozwijać przy użyciu całkiem niezłego systemu. To dało nam dobre wyobrażenie o tym, czego się spodziewać, ale nadal pozostawia pytanie: "ile transakcji muszę zrobić, aby być dochodowym?"

I to jest dobre pytanie. Odpowiedź na to pytanie daje wiele wglądu w to, jakie warunki muszą być obecne, aby konsekwentnie zarabiać w określonym czasie. Jak już wspomniałem w innych postach, jak wielkie biura handlowe, takie jak Goldman Sachs, zarabiają 9 lat na 10 lat. To również pozwoli na sprawdzenie Twojego systemu i upewnienie się, że faktycznie działa tak, jak powinien.

Przejdźmy do liczb. Napisałem skrypt, który wykona 100 000 symulacji serii transakcyjnej o wartości X transakcji. Następnie przygląda się każdemu z nich, aby określić prawdopodobieństwo bycia w zyskach na końcu tej serii. Używa tego samego systemu co w ostatnim poście. 50% wygranych, 5 Pip SL, 7 Pip TP i 0.5 Pip Spread

WIN RATE: 50% | SL: 5 | TP: 7 | SPREAD: 0.5

Series Length	POP
10	62.39%
20	58.79%
30	70.69%
40	68.10%
50	76.06%
60	74.19%
70	73.93%
80	78.22%
90	76.89%
100	81.59%
125	81.25%
150	85.61%
175	85.49%
200	88.53%
225	88.62%
250	90.82%
275	90.74%
300	92.43%
325	94.11%
350	93.95%
375	95.17%
400	95.06%
425	95.98%
450	95.99%
475	96.74%
500	96.76%

Dość niesamowite rzeczy. W każdej serii 10 transakcji masz tylko 61% szans na zarobienie pieniędzy. W każdej serii 100 transakcji masz tylko 81% szans na zarobienie pieniędzy. Oznacza to, że normalna byłaby seria 100 transakcji, w których ostatecznie przegrywasz pieniądze na każde 500 transakcji. Jeśli 5 osób wybierze ten system, a każdy wykona 100 transakcji. Jeden z nich straci pieniądze, a to będzie całkowicie normalne ze statystycznego punktu widzenia.

Aby mieć 95% pewności, że będziesz zarabiać w określonym czasie, musisz mieć 500 niezależnych zdarzeń. Biura trejdingowe mają tak wielu trejderów, że ich liczba zdarzeń dla Biura może z łatwością przekroczyć 500 transakcji. Taki samo jest z HFT. Nie zarabiają każdego dnia, bo oszukują. Zarabiają każdego dnia, ponieważ rozumieją liczby.

WIN RATE: 93.5% | SL: 36 | TP: 4 | SPREAD: 0.5

Series Length	POP
10	51.15%
20	62.42%
30	69.18%
40	73.83%
50	77.66%
60	80.62%
70	82.90%
80	73.69%
90	77.09%
100	79.00%
125	80.73%
150	89.01%
175	89.32%
200	89.64%
225	90.43%
250	90.84%
275	94.17%
300	94.33%
325	94.62%
350	94.87%
375	95.03%
400	95.21%
425	96.95%
450	97.20%
475	97.14%
500	97.34%

Zwróć uwagę, że liczba różni się od innego systemu, ale nie drastycznie lub w jakiś znaczący sposób. W niektórych seriach ten system jest bardziej skłonny do generowania zysku, a w innych seriach drugi system jest bardziej prawdopodobny. Oba systemy potrzebują 500 niezależnych zdarzeń, aby mieć 95% pewności, że na końcu serii pojawi się zysk.

Pomyśl o tym: gdybyśmy mieli 100 trejderów wybierających pierwszy system i 100 trejderów wybierających drugi system, i każdy zagrałby 400 trejdów. 5 trejderów z każdej grupy będzie nadal tracić pieniądze po 500 transakcjach z wygrywającymi systemami i **to będzie statystycznie normalne.**