

Trading System: Profitable Day						
Інструменти	Таймфрейм	Фундаментальний аналіз	Технічний аналіз	Управління капіталом	Визначення точки входу	Визначення точки виходу
FOREX: • Majors • USDX	D1	Фундаментальний аналіз використовується для визначення монетарної політики Центробанку, а також поточної економічної ситуації • Аналізуємо монетарну політику ЦП • Аналізуємо ВВП • Аналізуємо інфляцію • Аналізуємо ринок праці • Аналізуємо обсяг продажів	Технічний аналіз використовується для визначення тренду, корекційних зон та пошуку точки відкриття позиції.	Контроль ризиків здійснюється за допомогою скрипта "Open order script", який розраховує максимальний обсяг торгової угоди. Для визначення обсягу необхідно знати за якою ціною здійснюватиметься вхід у позицію та за якою ціною визначатиметься вихід із ринку. Знаючи ціну вхід (Po) та ціну SL (Psl) – визначається різниця в пунктах. На основі ціни пункту (Pp) визначається максимальний обсяг позиції таким чином, щоб у разі досягнення SL угода закрилася з не більше ніж заданим ризиком/збитком. Рівень Stop Loss спрацьовує лише після закриття свічки за його рівнем. Тому негативний результат може бути більшим за робочий ризик, але в рамках люфту між робочим і максимальним ризиком.	Точка входу визначається за двома сценаріями: 1. За розворотними сигналами Реалізується за допомогою технічного індикатора Reversal Patterns (Pin Bar, Harami, Engulfing) 2. За пробійними сигналами Реалізується за допомогою технічних індикаторів Angry Alligator та Price Channel & Bollinger Bands Підтверджуючим фільтром для відкриття торгової угоди є осцилятор Universal Oscillator: • Для розворотних сигналів: Значення гістограм повинні бути вищими за лінію балансу для коротких позицій і нижче для довгих позицій • Для пробійних сигналів: Значення гістограм повинно бути вище лінії балансу для довгих позицій та нижче для коротких позицій У логіці торговельної системи передбачено додавання в позицію, у разі незафіксованого прибутку за першою угодою по тому самому активу. Додавання до позиції здійснюється за сигналами індикатора Universal Oscillator: • Для розворотних сигналів: Якщо за першою угодою є незафіксований прибуток, при формуванні сигналу Crossed zero line за індикатором Universal Oscillator відкривається додаткова угода таким же обсягом. • Для пробійних сигналів: Якщо за першою угодою є незафіксований прибуток, при формуванні сигналу "Sourcer" за індикатором Universal Oscillator відкидається додаткова угода таким самим обсягом.	Точка виходу визначається за трьома сценаріями: 1. Закриття угоди щодо досягнення рівня Take Profit Здійснюється після того, як прибуток за угодою досяг встановленого співвідношення прибуток до збитку. Для розворотних угод 5к1. Для трендових 3к1. Тобто рівень TP розміщується в 5 і в 3 рази далі від рівня відкриття угоди, ніж SL. 2. Закриття угоди щодо досягнення рівня Break-even Здійснюється після того, як рівень прибутку за угодою досягає певного відсотка прибутку (угода переноситься до зони беззбитку) та розгортається до ціни відкриття. За такої цінирії угода закривається "в нуль" і подібний рух може трактуватися як хибний розворот/пробою. 3. Закриття угоди щодо досягнення рівня Stop Loss Може здійснюватися двома способами для пробійних сигналів: • Закриття за локальним мінімумом/максимумом за певну кількість барів (встановлюється SL за локальний мінімум/максимум залежно від того, в який бік пробій) • Закриття за лініями індикатора Angry Alligator у протилежний бік ніж пробій. * Якщо пробійний сигнал утворився поблизу індикатора Angry Alligator (перетинає лінії або в каналі) - вибираємо метод SL "SL on local min/max. **Для розворотних сигналів рівень SL виступає high/low розворотної свічки в залежності від того, в який бік розворот.
Commodities: • Oil (BRN, WT, CL, HO) • Metals (XAU, HG)		Фундаментальний аналіз використовуємо для визначення дисбалансу між попитом та пропозицією • Аналізуємо динаміку видобутку • Аналізуємо попит та пропозицію • Аналізуємо фундамент світових споживачів та світових експортерів	Технічні індикатори: • Reversal signal • Angry Alligator • Price Channel & Bollinger Bands • Universal Oscillator Технічні інструменти для аналізу: • Рівні підтримки та опору • Рівні Фібоначчі • Хвильовий аналіз	Робочий ризик угоду = 0.78% Максимальний ризик угоди = 1% *Робочий ризик на угоду - визначається визначення обсягу торгової операції *Максимальний ризик на угоду - при досягненні цього ризику угода закривається по ринку (не чекаючи закриття свічки)	Точка входу визначається за допомогою технічних інструментів для аналізу. Оскільки рішення про відкриття довгої чи короткої позиції виходить із фундаментального аналізу (розрахунки), технічний аналіз служить безпосереднього відкриття угоди убік фундаментального прогнозу. Відкривати торгову позицію варто лише у корекції або при розвороті ціни у бік прогнозу за такими технічними сигналами: • Відбій від рівня підтримки, опору або Фібо • Розворотні патерни • Початок нової хвилі у бік прогнозу * Угода може бути повторно відкрита тільки в тому випадку, якщо була закрита за "Break-even", не досягла значень SL і знову пішла у бік прогнозу. У такому цінарії точкою сходу послужить раніше досягнутий рівень, а обсяг позиції логічно буде зменшено, адже нова ціна входу матиме більшу відстань від відкриття позиції та рівнем SL у пунктах. **Підхід "на пробій" не використовується.	Точка виходу визначається за трьома сценаріями: 1. Закриття угоди щодо досягнення рівня Take Profit Здійснюється після того, як вартість акції досягає ціни прогнозованого розрахункового рівня, виходячи з фундаментального аналізу. Для більшої надійності встановлюється рівень Фібоначчі або рівень підтримки/опір поблизу прогнозованого значення. 2. Закриття угоди щодо досягнення рівня Break-even Здійснюється після того, як вартість акції досягла заданого відсотка прибутку, але розгорнулася до відкриття. Для зменшення ризиків угода закривається і може бути знову перевідкрита після пробою раніше досягнутого рівня, якщо котирування не досягли SL. 3. Закриття угоди щодо досягнення рівня Stop Loss • Якщо угоду відкрито відбою від рівня підтримки, опору або Фібо, то SL встановлюється за обраним рівнем • Якщо угоду відкрито за розворотними патернами, то SL встановлюється за low/high патерна • Якщо угоду відкрито за хвильовою структурою, SL встановлюється на локальному мінімумі/максимумі поточної хвилі (або найближчим рівнем підтримки, опору або Фібо).
Shares • All stock		Фундаментальний аналіз використовується для визначення фінансової стабільності компанії та відхилення від поточної ціни чи динаміки сектора • Проводимо фінансовий аналіз компанії (файл: Financial Analysis) • Шукаємо розходження між динаміками котирувань та фінансовими даними • Визначити недооцінені та переоцінені акції • Якщо вартість акцій на ринку набагато дешевша / дорожча за розрахункову вартість, то слід шукати точку входу виходячи з їх технічного аналізу	Технічний аналіз використовується для визначення тренду, корекційних зон та пошуку точки відкриття позиції. Технічні індикатори: • Reversal signal Технічні інструменти для аналізу: • Рівні підтримки та опору • Рівні Фібоначчі • Хвильовий аналіз			