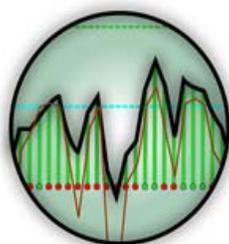


Торговая стратегия Woodie's CCI

ОПИСАНИЕ



Woodie's CCI Club

"Traders Helping Traders"

Оригинальный материал в переработке

Джеймс Л. О'Коннелл (PFG)

Русский текст

Тренкеншу Олег (пока просто так)



Для начала хотелось бы поблагодарить сотрудника компании PFG (Peregrine Financial Group and Peregrine Charities) Джима О'Коннелла за обработку документации, так как оригинал требовал систематизации. Джим провел много времени составляя данную статью, которая призвана помочь трейдерам по всему миру в их торговле и освоении ССИ. Руководствуясь девизом "Трейдеры помогают трейдерам", Джим проделал отличную работу. Надеюсь все, кто прочтут эту статью и изучат особенности ССИ, будут успешно работать, используя данную стратегию. Большое спасибо, Джим, ОТЛИЧНАЯ РАБОТА.

Вуди (Woodie)

Для начала хотелось бы немного сказать о том, что данная торговая система предоставляется ее автором Вуди абсолютно бесплатно. Тысячи людей во всем мире пользуются ей, причем весьма и весьма успешно. Большим плюсом является то, что эта стратегия идеально подходит для небольших депозитов, что делает ее особо привлекательной.

Этот документ создан для того, чтобы предоставить вам базовые знания о системе Woodies ССИ, вы познакомитесь с тем, как она используется на практике, как применять шаблоны на вход в рынок и выход из него. Так же будет предложена платформа для тренировочной (демо) торговли. Девиз Вуди: "Трейдеры помогают трейдерам". Мы надеемся, что это руководство будет Вам полезно.

www.woodiescciclub.com

Удачи!

Принцип Woodies CCI. Основным принципом является то, что цена движется вслед за линией CCI. В анализе тренда, входов и выходов участвует только CCI. Все шаблоны, описанные ниже, многократно проверялись и предназначаются для облегчения понимания динамики CCI.

Woodies CCI charts

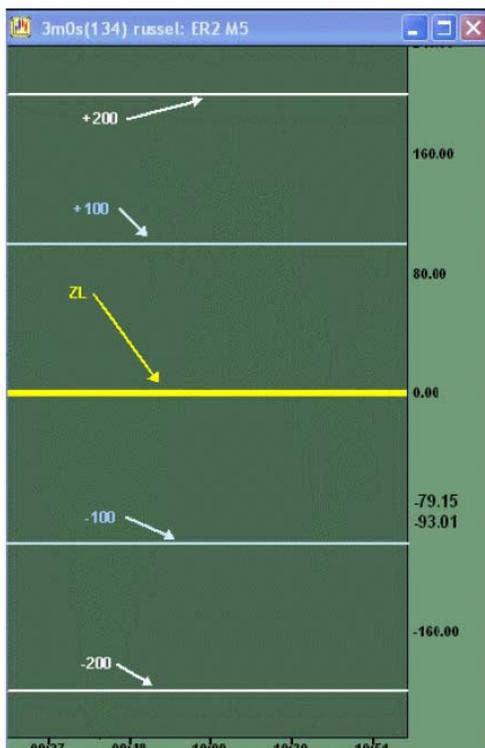


Chart 1

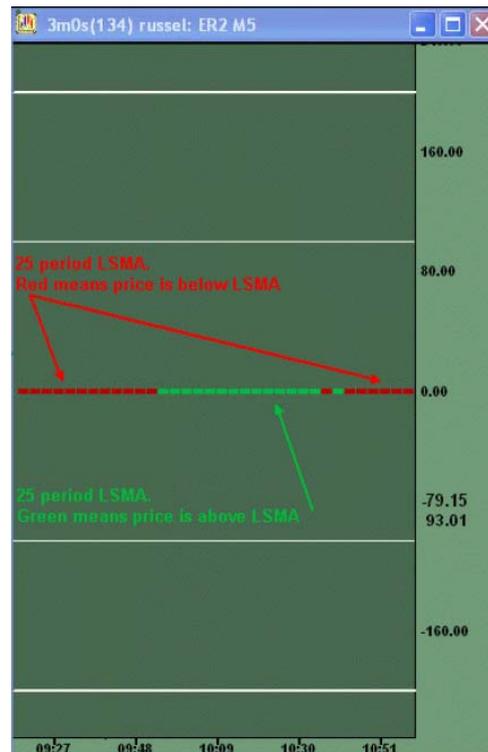


Chart 2

На графике 1 изображена прямая желтая линия. Она называется "нулевая линия" (Zero-line, **ZL**). Эта линия имеет особое значение, так как участвует в определении шаблонов, текущего тренда и т.д. Также на графике имеются еще четыре вспомогательные линии +/-100 и +/-200 соответственно. Эти значения - ключевые поддержки и сопротивления CCI. Об их значении мы поговорим чуть позже. На графике 2 ZL представлена красными и зелеными пунктирами. Эти пунктиры отображают состояние скользящей средней под названием **LSMA**. Когда цена выше LSMA, пунктиры окрашены в зеленый, если ниже - в красный. Вообще данный индикатор несет чисто информативный характер и служит для подтверждения открытия позиции. Мы стараемся открывать позиции только в направлении LSMA.

Zero-Line

Нулевая линия является важнейшей поддержкой/сопротивлением.

Подробнее:

- Поддержкой либо сопротивлением она является в данный момент времени, ее значение в будущем может измениться, и наверняка изменится.
- CCI пересекает эту линию и отскакивает от нее несколько раз за торговую сессию.
- Тренд определяется по количеству баров выше или ниже ZL. Их должно быть 6 и более. Если линия CCI пересекает ZL, это еще не означает смену тренда. Лишь 6 или более баров на одной стороне от ZL определяют наличие направления на рынке. Мы стараемся торговать только в направлении тренда. Этот принцип позволяет извлекать максимум прибыли из торговли.
- Когда на рынке нет определенного тренда, позиции не открываются. Торговля ведется только при наличии тренда.
- Наблюдая за CCI, следует обращать внимание на пересечения линии индикатора с ZL. Это может означать дальнейшую смену тренда, либо на графике обрисовывается какой-либо шаблон. Но,

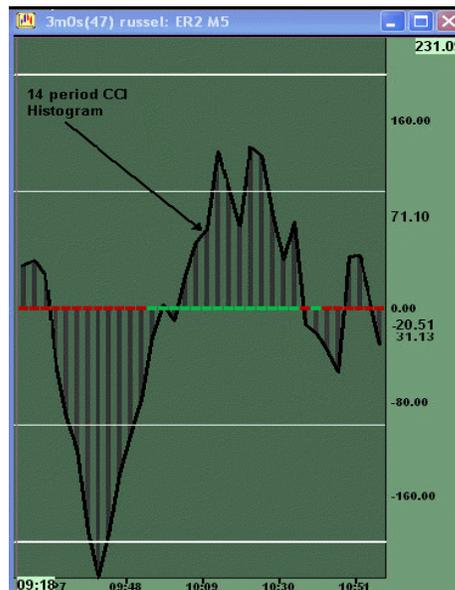


Рис. 3

На графике 3 изображен CCI. Он черного цвета на всех графиках Вуди. Вертикальные линии мы будем называть временными барами. Для нас нет необходимости полностью понимать математический расчет CCI, но если у кого-то есть желание понять математическое определение CCI, посетите www.stockcharts.com/education/IndicatorAnalysis/indic_CCI.html

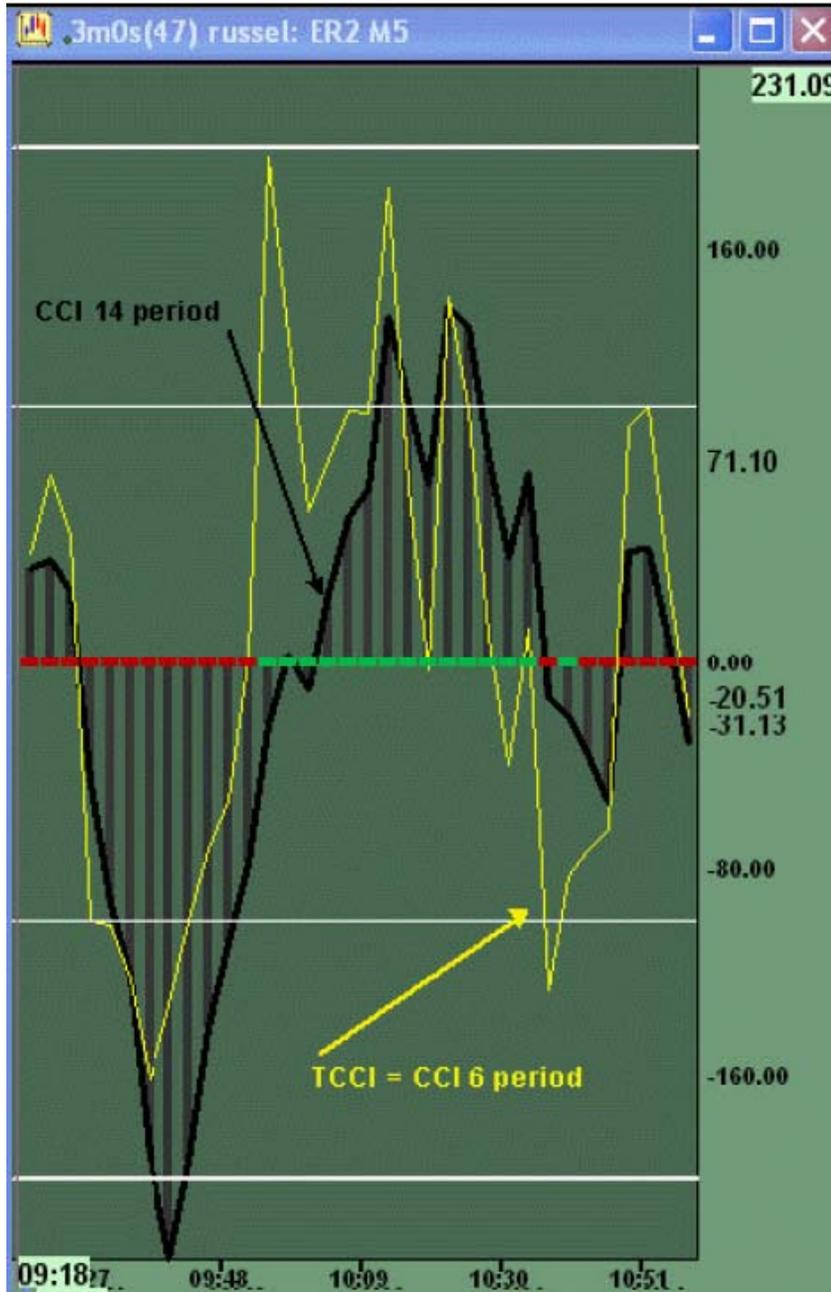


Рис. 4

На 4 графике появилась еще одна линия желтого цвета. Вуди использует два индикатора CCI для торговли. Один 14-периодный черного цвета, называемый CCI. Другой 6-периодный желтого цвета - Turbo CCI или TCCI. Основной ролью TCCI является участие в определении шаблонов, а также возможных точек выхода из сделок.

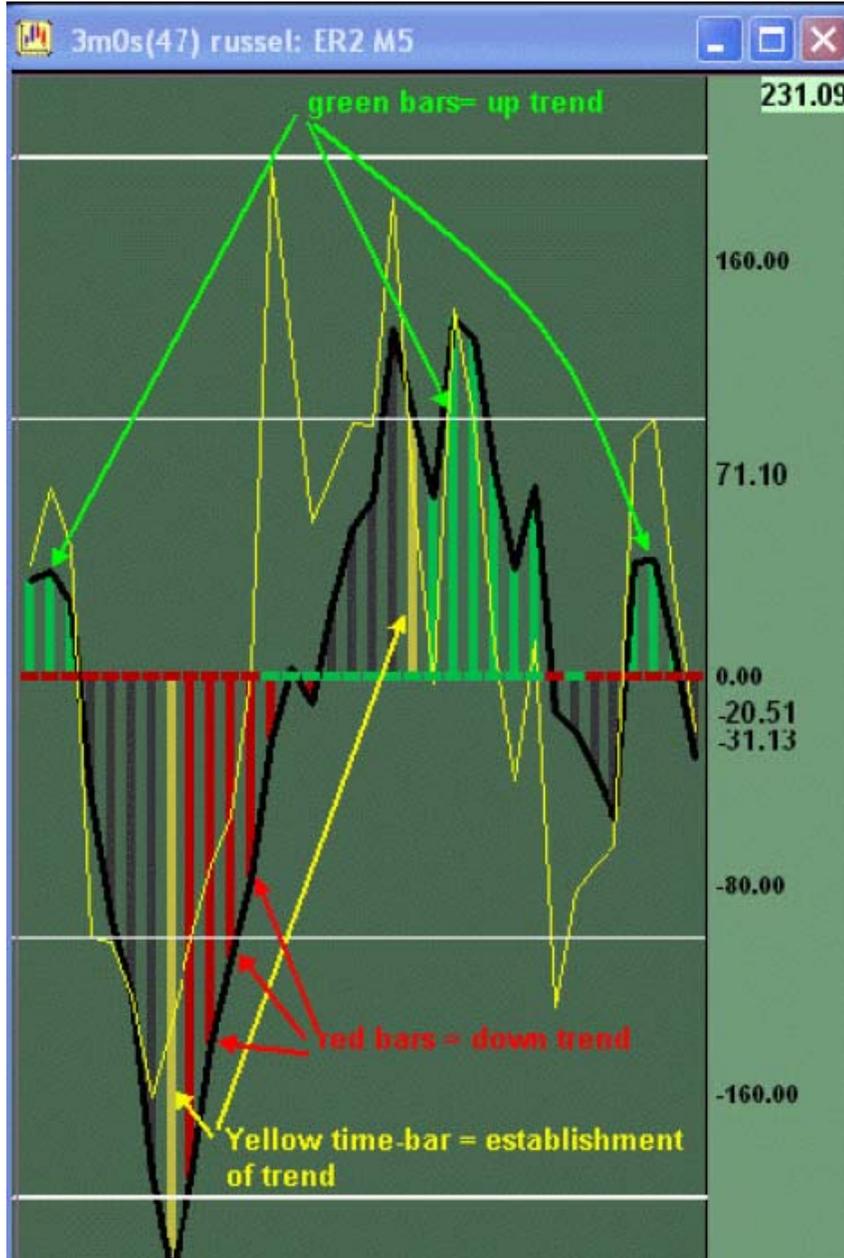


Рис. 5

На 5 графике временные бары раскрашены в разные цвета. Бары серого цвета свидетельствуют об отсутствии или возможности смены тренда, золотые бары сигнализируют о начале тренда, зеленые и красные бары говорят о том, что на рынке в данный момент происходит восходящее либо нисходящее движение соответственно.

The Trend

- trend *n.*
- The general direction in which something tends to move.
 - A general tendency
 - General line of orientation
 - *syn* tendency
 - *syn* course
 - *syn* drift, movement
 - *syn* vogue, style

Тренд по Woodies CCI: Вуди определяет тренд по положению CCI относительно нулевой линии. Шесть или больше баров/свечей выше нее - тренд положительный, ниже - отрицательный.

Подробнее:

- Только индикатор CCI показывает тренд.
- Ценовые бары/свечи на других графиках в определении тренда не участвуют.
- Также не используются другие индикаторы.
- Не используются другие таймфреймы.
- Текущий тренд мы определяем на том CCI графике, на котором торгуем.
- Вуди рекомендует торговать только по тренду. Не стоит торговать контр-тренд шаблоны, пока вы не научитесь правильно вести торговлю по тренду!

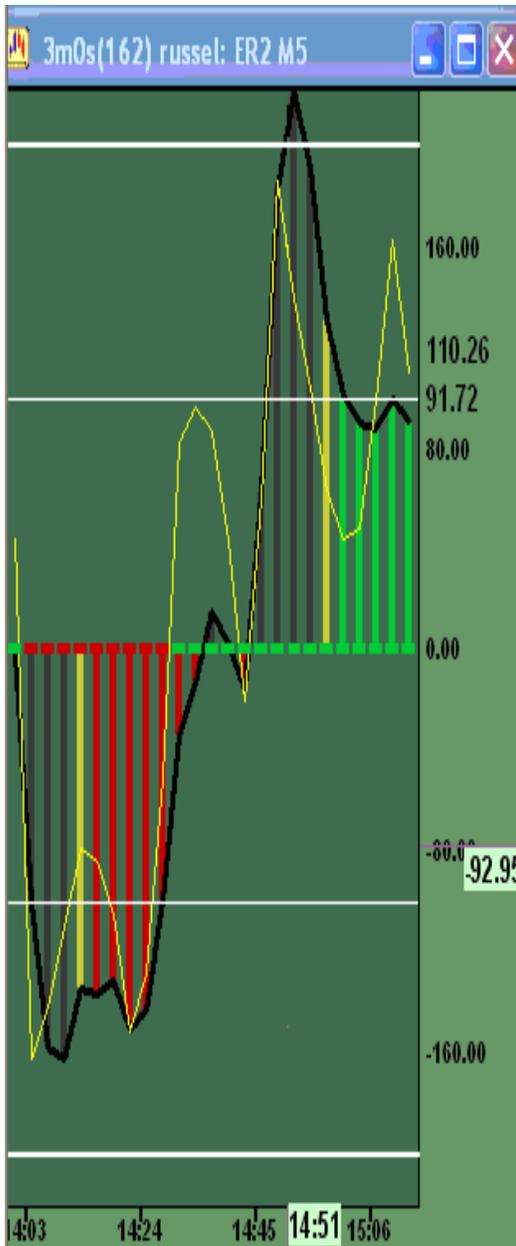


Рис. 6

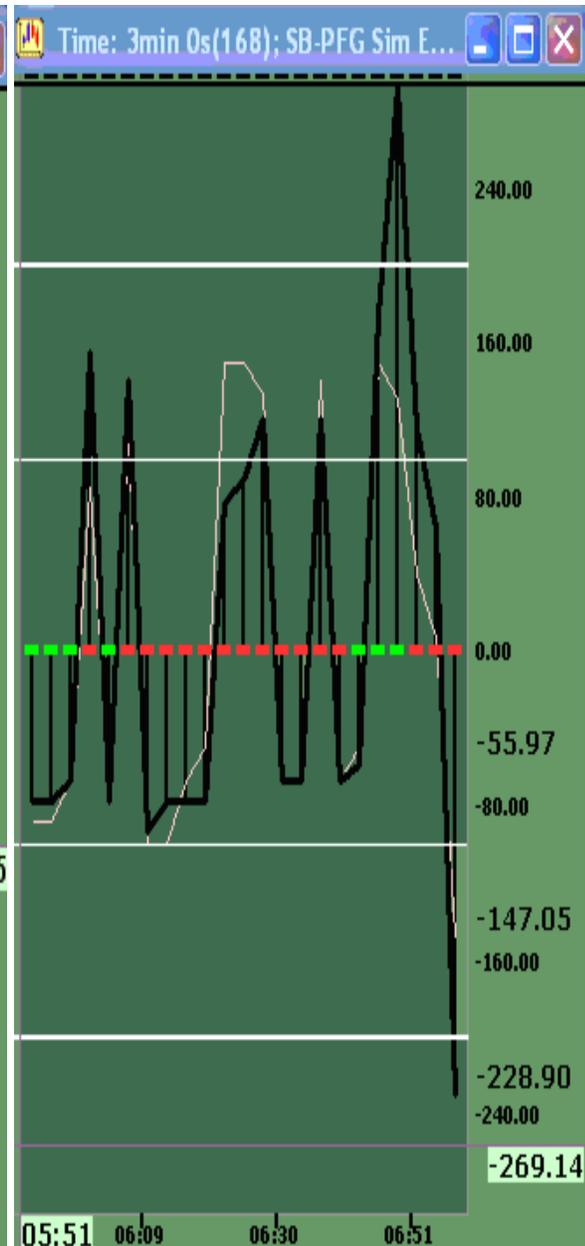


Рис. 7

После золотого бара на графике 6 начался тренд на понижение. Через некоторое время СС1 пересекает нулевую линию, но мы не принимаем это за смену тренда. Пока минимум 6 баров не появятся выше нулевой отметки, мы все еще считаем, что у нас нисходящее направление на рынке и мы ищем возможность для открытия короткой позиции. Но, чем больше баров рисуется выше нуля(3,4,5), тем больше вероятность смены тренда на восходящий. Мы имеем это ввиду. Через некоторое время обрисовывается желтый бар, что говорит нам о реальной смене тренда. Все дальнейшие позиции, которые мы открываем, будут исключительно на покупку (до следующей перемены направления естественно).

На графике 7 невозможно определить какой-либо тренд. Нет тренда - нет торговли.

Теперь познакомимся с шаблонами, которые дают возможность торговать по тренду.

Шаблоны для торговли в направлении тренда

1. Zero-line Reject - Отскок от нулевой линии (**ZLR**).
2. Reverse Divergence - Отклонение с разворотом (**RD**)
3. Trend Line Break - Пробой линии тренда (**TLB**)
4. Horizontal Trend Line Break - Пробой горизонтальной линии тренда (**HTLB**)

Для начинающих трейдеров данные 4 шаблона должны стать единственными, применяемые в торговле, по крайней мере пока идет обучение системы. Не стоит также торговать не попрактиковавшись на демо

Zero-line Reject (ZLR)

Этот шаблон определяется следующим образом. ССИ показывает определенный тренд (это условие в дальнейшем не будет оговариваться для тренд-следующих шаблонов). Далее линия ССИ подходит к нулевой линии (не доходя, либо немного заходя за ZL). Обычно удовлетворяющим условием являются зоны +/-100, +/-50 (кто-то предпочитает зону +/-30). Затем ССИ разворачивается и тем самым подтверждает тренд. Как раз здесь и находится наша точка входа в трейд. Подробнее о входе и выходе мы поговорим позже.

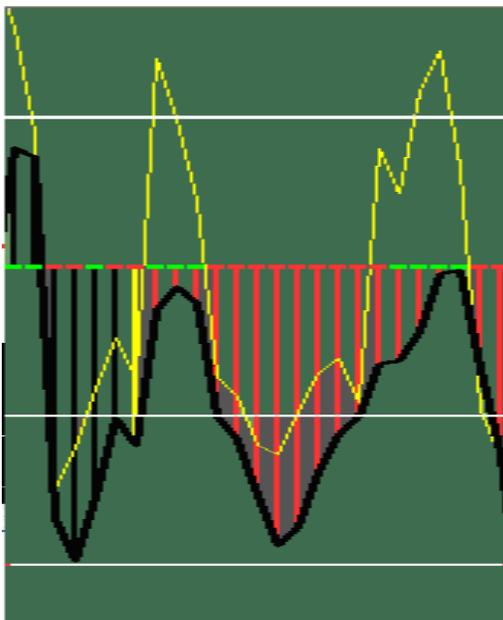


Рис. 8

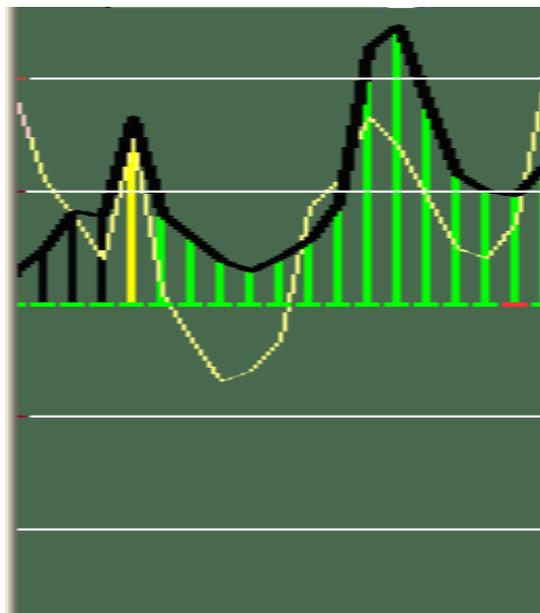


Рис. 9

График 8

Здесь изображены сразу 2 ZLR. Установился даунтренд (тренд в низ) - 6 баров ниже ZL. В обоих случаях CCI приближается или касается ZL, а потом как-бы отскакивает от нее, давая команду на продажу. Как правильно войти в трейд мы обсудим позже. Сейчас важно научиться распознавать шаблоны

График 9

Здесь тоже ZLR, только в аптренде (тренд вверх).

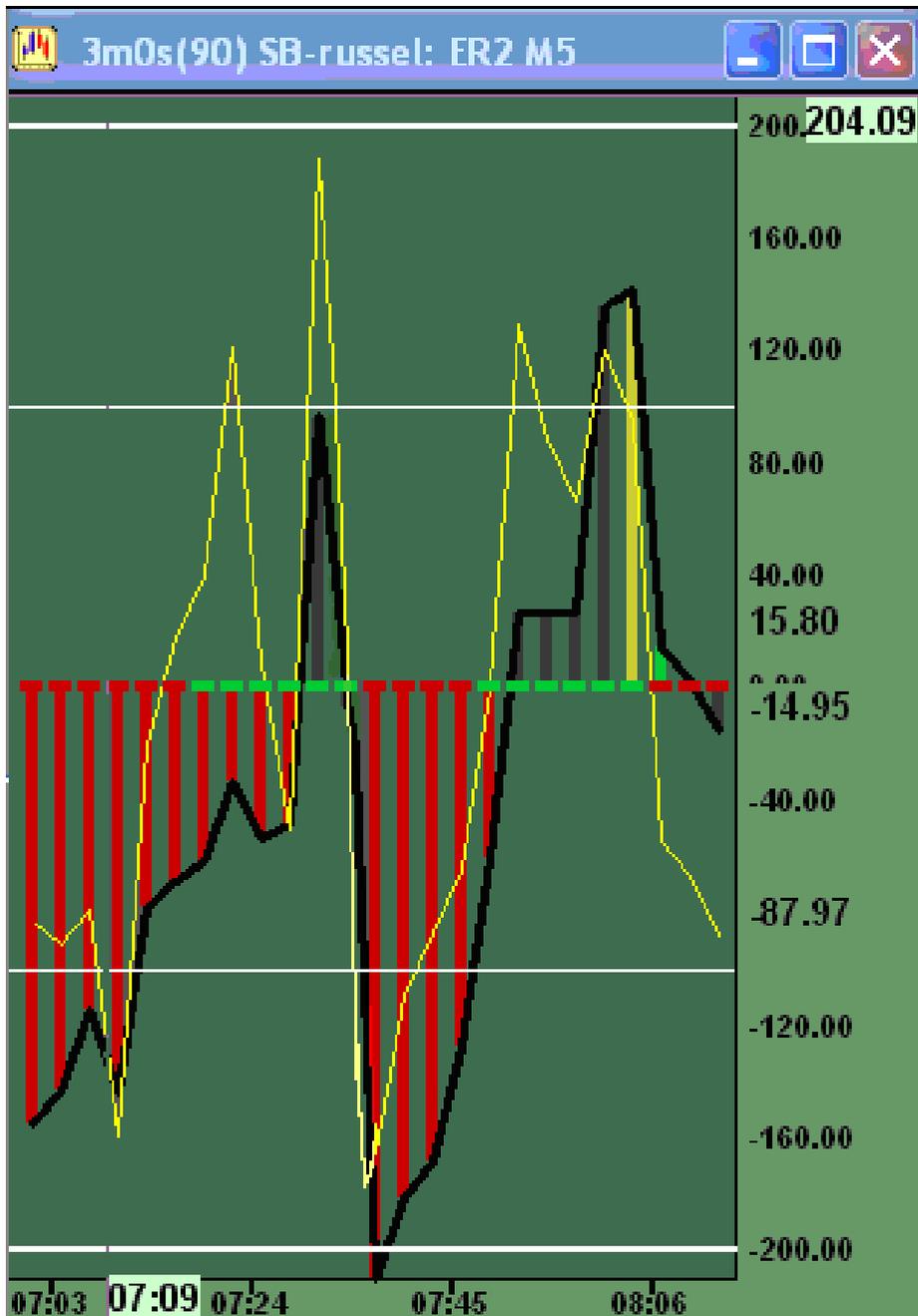


Рис. 10

График 10 так же показывает ZLR, где CCI пересекает ZL и потом возвращается в направление тренда. Мы торгуем только тогда, когда CCI возвращается за нулевую линию. Пока CCI не вернулся за ZL, в зону нисходящего тренда, мы не считаем, что у нас сложился ZLR.

Reverse Divergence (rev diver-RD)

Это вторая фигура подтверждения тренда. После того, как установился конкретный тренд, мы смотрим, есть ли пики и провалы на индикаторе, такие, чтобы по пикам можно было начертить линию тренда по направлению к нулевой линии, а провалы были второй ниже первого. Нам необходимо 2 пика или 2 провала. Чтобы нарисовать линию тренда можно использовать как ССІ, так и ТССІ. Для подтверждения этого шаблона должно присутствовать пересечение основных линий (+/-100, ZL) и затем нарисованной нами ранее линии. Краткая схема будет иметь вид "пик - провал - пик - провал - пересечение нашей линии".



Рис. 11

На 11 графике два RD. В обоих случаях у нас есть 2 пика, причем линия которая их соединяет направлена к ZL. Провалы так же удовлетворяют условие для провалов (второй ниже чем первый) и наконец пробой нарисованной линии тренда, что дает нам сигнал buy (покупка). Следует еще раз обратить внимание на то, что в данном случае мы все так же продолжаем торговать вместе с установленным трендом. В обоих шаблонах имеет место ZLR с подтверждением RD.

Trend Line Break (TLB)

Это третья тренд-следящая фигура. Этот шаблон может быть как трендовым, так и контр-трендовым. Но для нас интересен только трендовый вариант. Линия тренда должна брать свое начало из зоны вне +/-100 или, что еще лучше +/-200. Для ее построения необходимо 2 и более пика. Чем больше точек соприкосновения CCI и нашей линии, тем она сильнее и тем значительнее будет сигнал. Так же как и в случае RD линия тренда прочерчивается по направлению к нулевой линии при помощи CCI и TCCI. Сигналом к торговле является пробой линии тренда в направлении текущего направления рынка (тренда). Чем ближе этот пробой происходит к ZL тем лучше. Зачастую TLB является подтверждением ZLR. Когда на графике обрисовываются одновременно 2 шаблона (один подтверждает другой), это означает, что торговый сигнал, который они дадут будет более весомым, и, как следствие этот трейд станет, с большой долей уверенности, успешным.

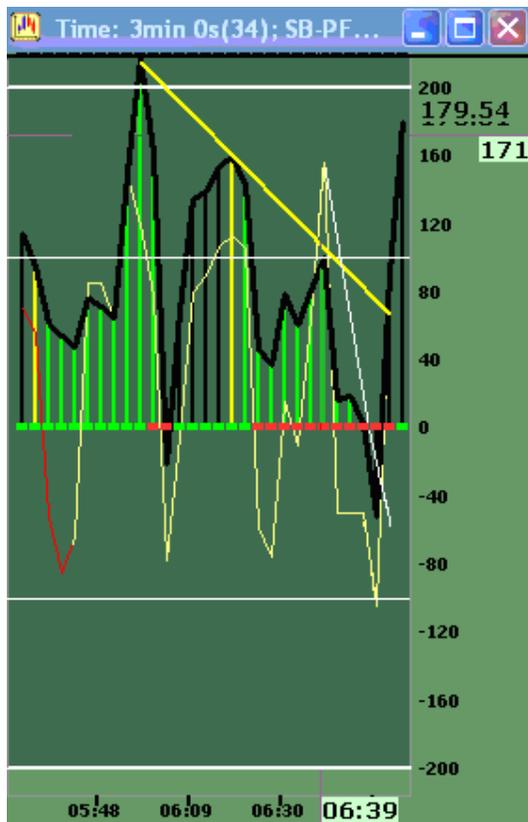


Рис. 12



Рис. 13

График 12 демонстрирует нам TLB при аптренде. Торговым сигналом является пробой линией CCI нарисованной нами линии тренда. Белый трендлайн изображен при помощи TCCI. Как правило такие линии более агрессивны, то есть дают более ранние сигналы ко входу в рынок.

На 13 графике нисходящий тренд. Картина та же, что и на предыдущем рисунке. Следует заметить, что в обоих случаях сначала происходил ZLR, а потом подтверждающий его TLB.

Horizontal Trend Line Break (HTLB)

Это последняя фигура подтверждения тренда. Смысл данного шаблона тоже заключается в пробитии опорной линии. Он может быть как тренд-следящим, так и контр-трендовым (второй вариант пока во внимание не принимаем). HTLB практически тоже самое, что и TLB, но в этом шаблоне пики должны располагаться на примерно одинаковой высоте. Линия HTLB должна возникать внутри области +/-100. Правила построения горизонтальной линии тренда те же, как в случае с TLB. CCI, пересекая нашу горизонтальную линию, дает сигнал к трейду. HTLB усиливается, если опирается на более чем 2 пика.

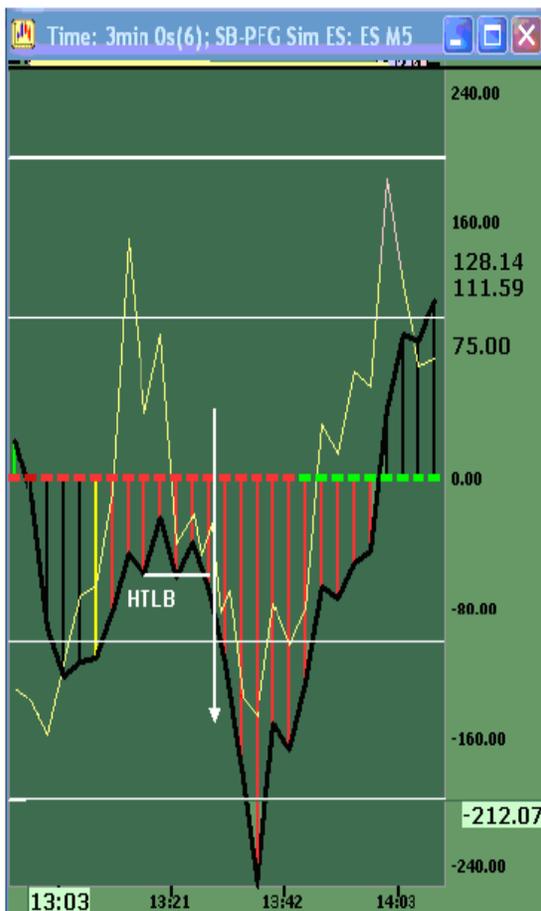


Рис. 14

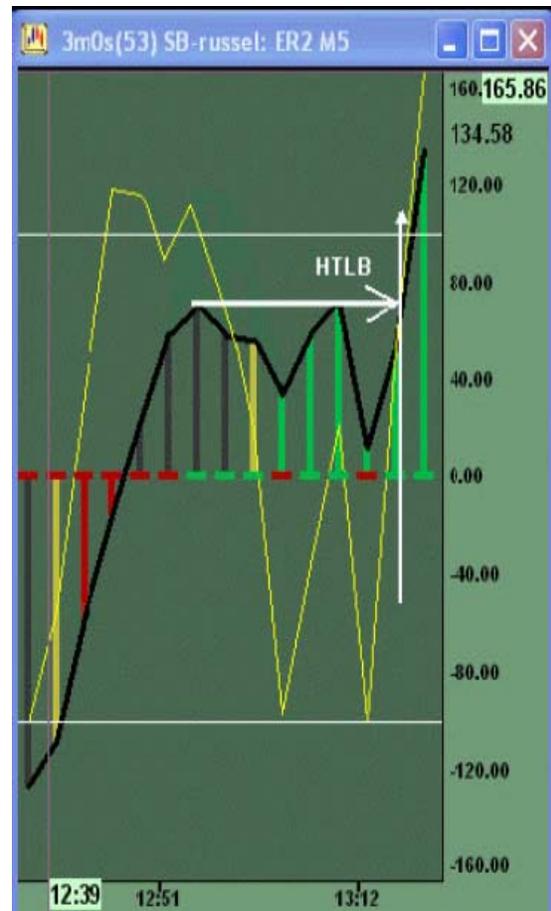


Рис. 15

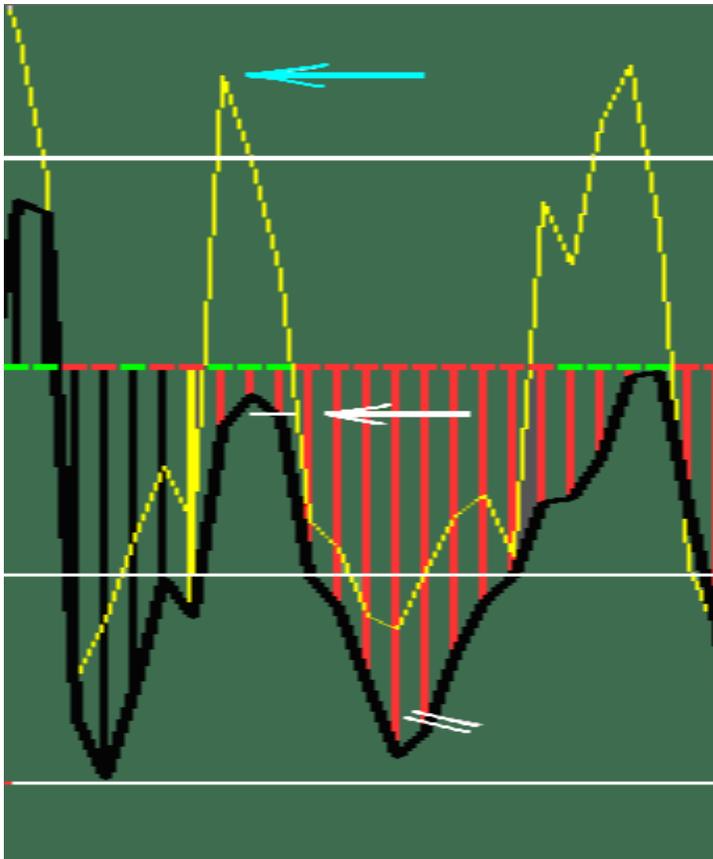
На 14 графике происходит HTLB при даунтренде.
На 15 графике происходит пробитие по аптренду.

Приступим к практике!

Итак, мы ознакомились с тренд следящими фигурами. Это все, что необходимо начинающему трейдеру, практикующему торговую систему **Woodies CCI**. Многие успешные трейдеры, торгующие по стратегии Вуди, используют только трендовые шаблоны. Мы рекомендуем сначала торговать на демо, научиться распознавать шаблоны Вуди и привыкнуть к системе, прежде чем переходить на реал.

Сейчас мы перейдем к правилам входа в трейд, так, как делает это Вуди.

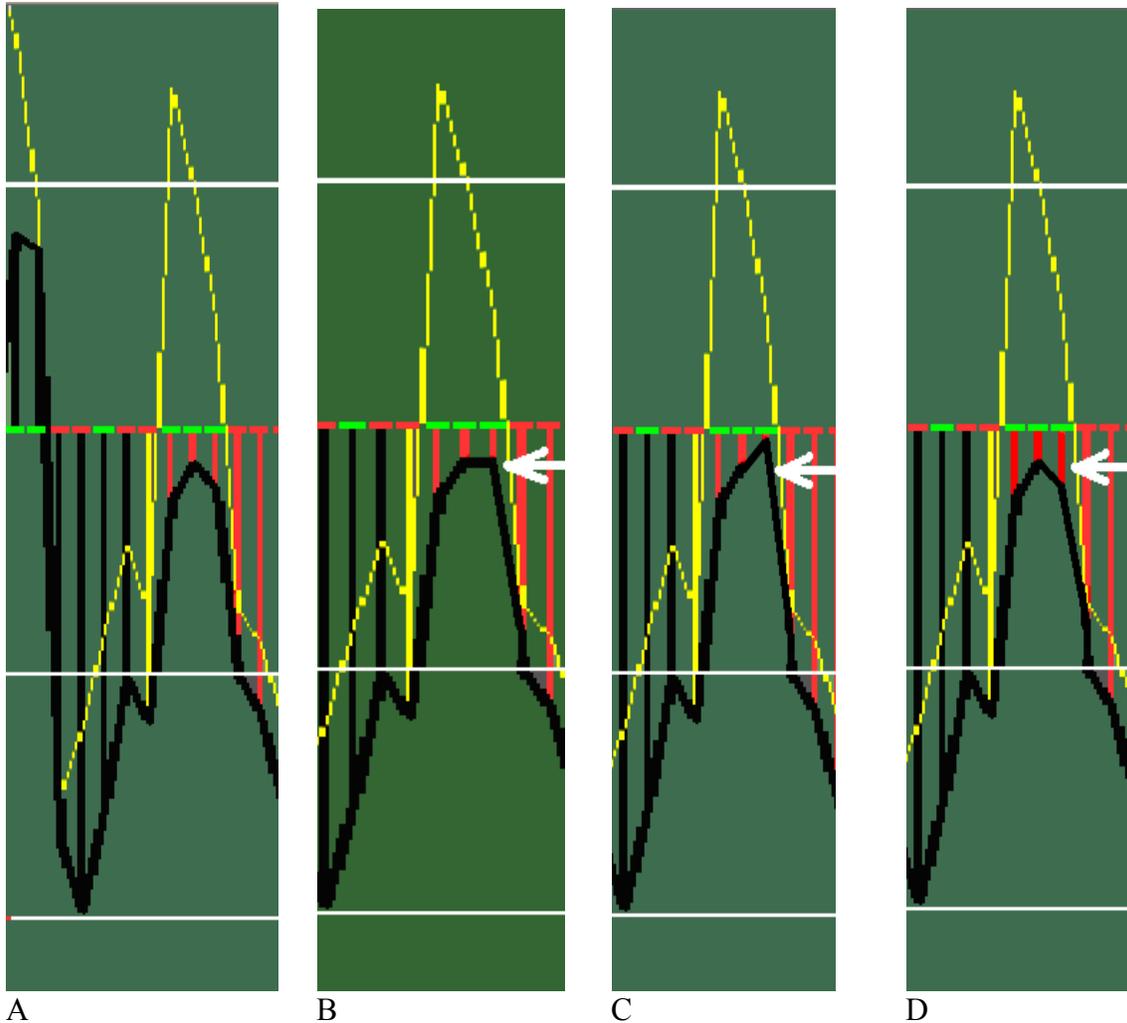
Возвращаемся к Рис. 8, ZLR.



Таймбар, на котором CCI развернулся в сторону установившегося тренда является точкой входа (белая стрелка). Мы продаем по «рынку».

Точкой выхода будет момент, когда CCI развернулся в противоположном направлении - обозначено двойным штрихом (ниже мы познакомимся со всеми правилами выхода из трейда поподробнее). Стоит обратить внимание на интересную особенность TCCI. Голубая стрелка показывает на пик TCCI. Как правило он пикует за бар или два до того, как сделает свой пик CCI. То есть мы заранее предупреждены, что с большой вероятностью у нас будет ZLR.

Отметим, что таймбар уже сформировался, когда мы взяли сигнал. Дело в том, что пока бар не закрылся, торговые сигналы могут несколько раз появиться и исчезнуть.



Мы видим 4 варианта шаблона, который отрисовывается еще до закрытия таймбара. Графики A и D показывают ZLR, но B и C нет. Это весьма затруднительный момент. Как поступить?

Ждать закрытия бара? (консервативный стиль).

Входить в трейд как только фигура сложилась, не дождавшись закрытия бара?

(Агрессивный стиль)

Вуди рекомендует открывать позицию примерно за 20 секунд до закрытия бара, на котором отрисовался определенный шаблон. Вы спросите: "Как определить, то, что до закрытия бара осталось 20 секунд"?

Торговая платформа **BESTDIRECT***fast*, кроме заранее подготовленного и настроенного шаблона для торговли по системе Вуди, имеет встроенный в графики секундомер.



Chart 16

На данном рисунке изображен ZLR, с оставшимися 18 секундами до закрытия бара. Все условия соблюдены. Мы продаем по «рынку». Настоятельно рекомендуется всегда следовать правилу 20-ти секунд. Вне зависимости от шаблона, по которому вы торгуете.

В то же время никогда нельзя забывать о стоп-лоссах. Вуди обычно использует стопы, выставленные выше входного бара на 1-2 тика.

Правила выхода

Правила выхода из позиции одинаковы для всех шаблонов. Их список приведен ниже. Главное, чтобы вы определили для себя те, которые больше подходят вам по стилю торговли.

- **CCI делает крюк или идет плоско, без тенденции**
- **CCI пробивает линию тренда не в нашу сторону**
- **TCCI пересекает CCI во внутрь**
- **CCI пересекает ZL**
- **CCI делает крюк из зоны экстремумов (вне+/-200) (HFE)**
- **CCI не двигается, нет прогресса**
- **LSMA показывает противоположное нашей позиции движение**

(Источник: **Trading Woodies CCI System** в исполнении Jeff'a)
www.woodiescciclub.com/Trading-Woodies-CCI-System.pdf

Мы рассмотрим только 3 из них. Остальные нужны для того, чтобы выходить из контр-трендовых позиций. Здесь они затронуты не будут. В дальнейшем вы узнаете о них подробнее, но лишь после того, как отточите простейшие знания, полученные из этого описания.

CCI делает крюк или идет флэт (плоско)

Вернемся к рис. 13.

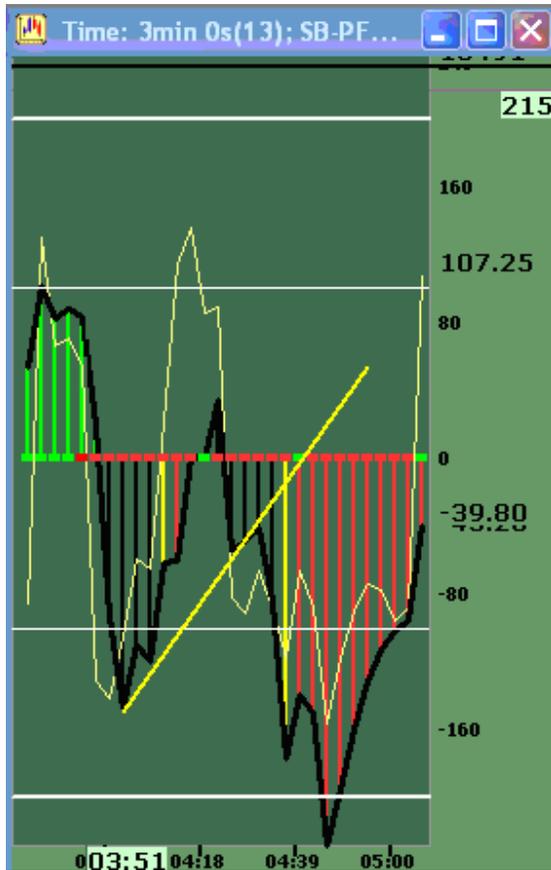


Рис. 13а

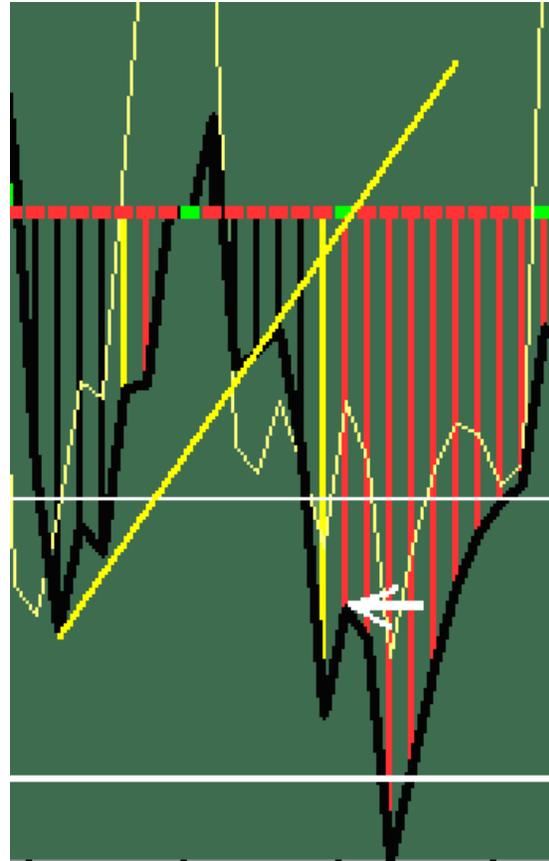


Рис. 13b

Здесь представлен TLB по тренду. Вход в рынок был выполнен по пересечению желтой линии тренда. Конечно же, мы не забыли про стоп, размещенный по правилам Woodies. Позиция держится открытой до того, как CCI делает крюк в направлении ZL. Так же как и при входе, мы применяем правило 20-ти секунд для закрытия трейда. Выход осуществляется на таймбаре, отмеченном стрелкой.

ТССИ пересекает ССИ

Посмотрим на рисунок 10.

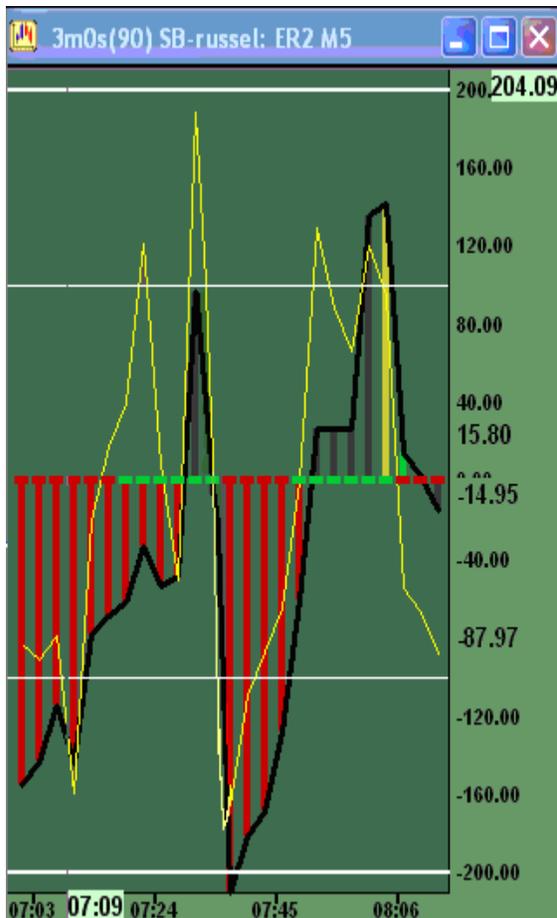


Рис. 10а

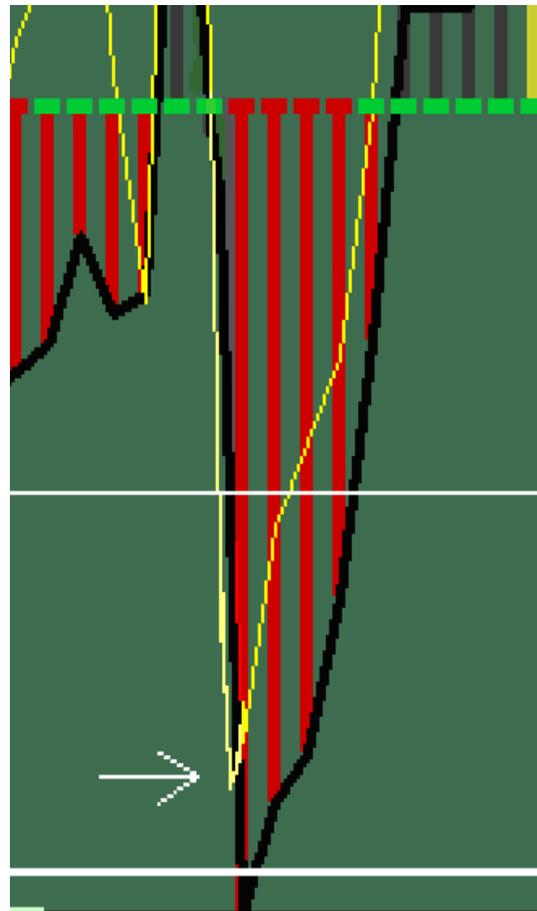


Рис 10b

Ранее мы определили, что здесь сформировался ZLR. ССИ развернулся в направлении установленного тренда и мы продали по «рынку». Позиция закрывается тогда, когда желтая линия ТССИ пересекает черную ССИ. На графике этот момент отмечен стрелкой.

CCI делает крюк из экстремума (HFE)

Это последнее правило выхода, которое должен использовать новичок. Оно похоже на обычный крюк CCI, с той лишь разницей, что здесь крюк происходит в зоне больших значений CCI (вне +/- 200). Здесь мы не дожидаемся закрытия бара и не соблюдаем правило 20-ти секунд. Как только CCI вышел за +/- 200 и начал движение против нас, мы сразу закрываем позицию. На рисунке 14b мы реагируем на сигнал CCI в месте, отмеченном стрелкой, и не ждем следующего таймбара.

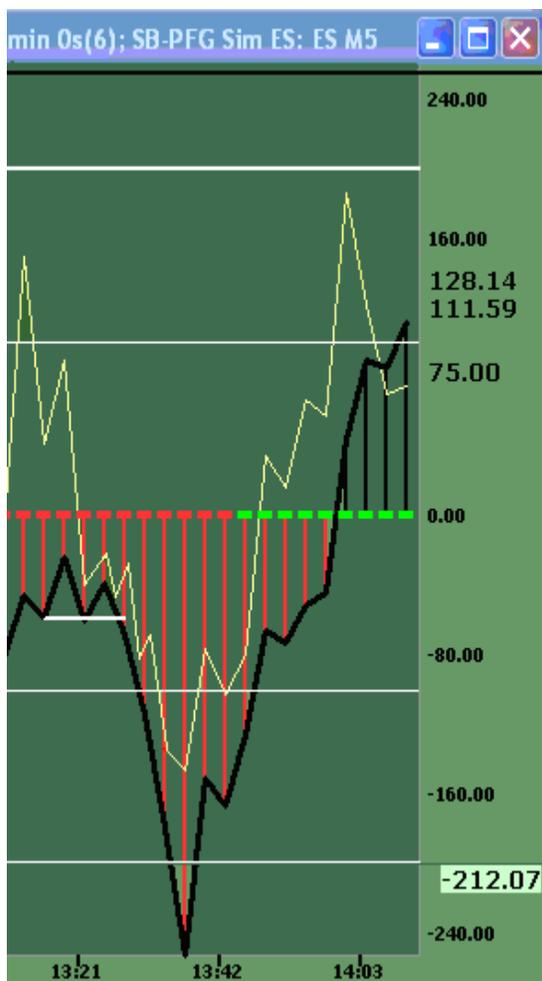


Рис. 14а

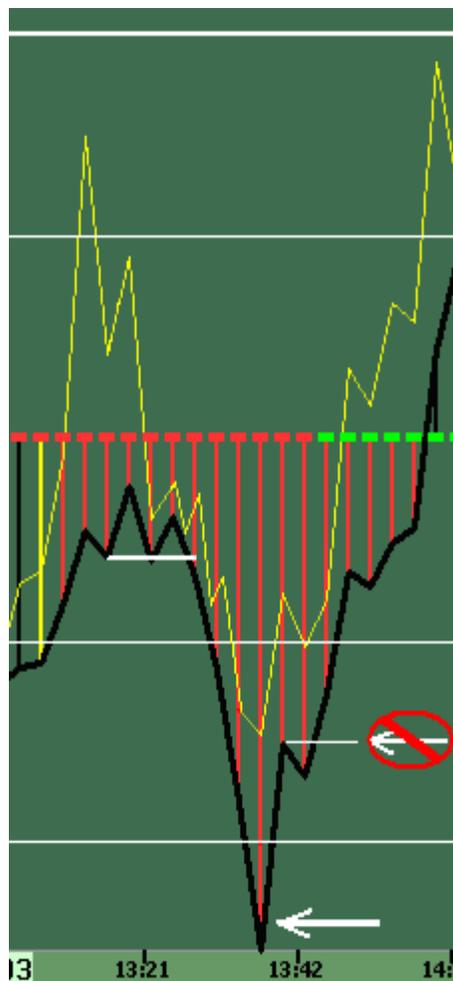


Рис. 14b

Контр-трендовые шаблоны и шаблоны смены тренда.

1. Фамир Шаму (Famir Shamu)
2. Вегас (Vegas)
3. Призрак (Ghost)
4. Крюк из экстремума (Hook from Extreme)
5. TLB контр-тренд
6. HTLB контр-тренд

Фамир (Famir)

Фамир представляет собой ZLR, который оказывается ложным на следующем же таймбаре. Фамир лучше всего работает в области +/-50. Этот Шаблон очень сложен для новичков, причем не в том, чтобы его распознать, а чтобы прочувствовать трейд и понять стоит ли его брать или нет. Начинающий трейдер может тяжело воспринять то, что необходимо открывать позицию, противоположную только что открытой (по сигналу от ZLR). К тому же если Фамир окажется ложным, то человек останется с ощущением полного проигрыша и тотального невезения. Это очень грустно, ведь Фамир очень эффективен и популярен среди последователей Вуди. Для успешного применения этого шаблона используется LSMA. Если LSMA показывает изменение направления (меняется окрашивание пунктиров ZL), то трейд можно взять. Приведенный ниже пример: LSMA показывает возможность торговли против даунтренда вверх, если ее окраска сменяется с красной на зеленую, и вниз против аптренда, если с зеленой на красную.

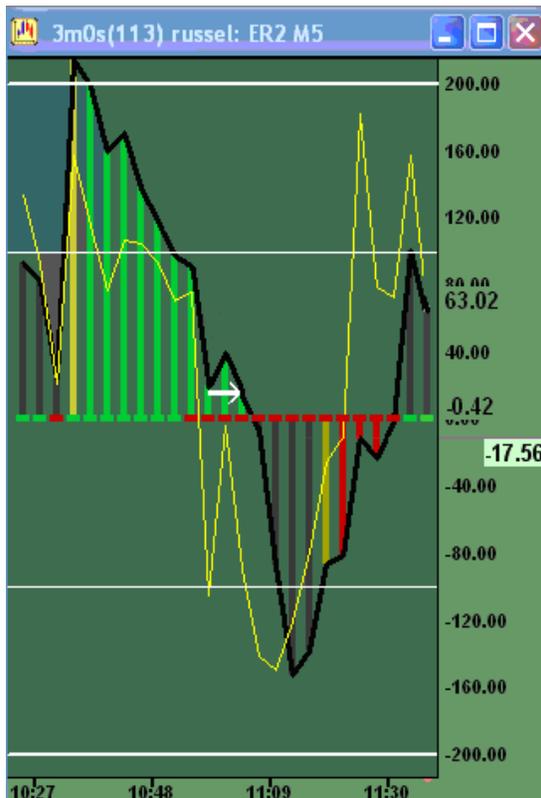


Рис. 17

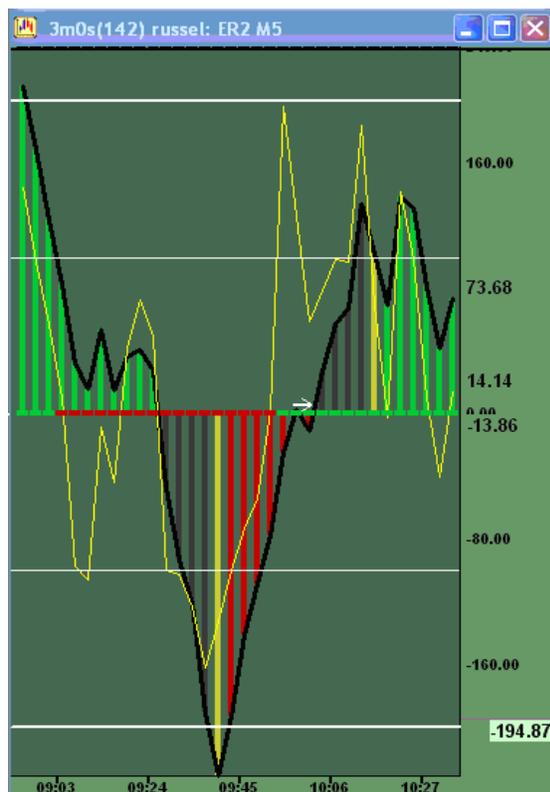


Рис. 18

На графике 17 изображен Фамир против аптренда. Обратите внимание, что LSMA красного цвета уже тогда, когда происходит ложный ZLR. Во время появления Фамира, LSMA уже красного цвета, что подтверждает сигнал.

График 18 демонстрирует Фамир после отказа ZLR через 1 бар. LSMA зеленого цвета, сигнал подтвержден.

Вегас

Вегас (VT) еще одна фигура контр-тренд. Опишем его элементы. Сначала ССИ выходит в экстремум по направлению текущего тренда (до +/-200 или выше). Затем возвращается ближе к ZL как минимум в зону +/- 100. После чего в течение 3 и более баров линия индикатора делает плавный разворот в сторону тренда. Этот разворот выглядит как небольшое округлое "углубление". Далее ССИ слегка продвигается в направлении тренда и вновь разворачивается. Сигналом к торговле является падение линии индикатора ниже ранее обозначенного "углубления".

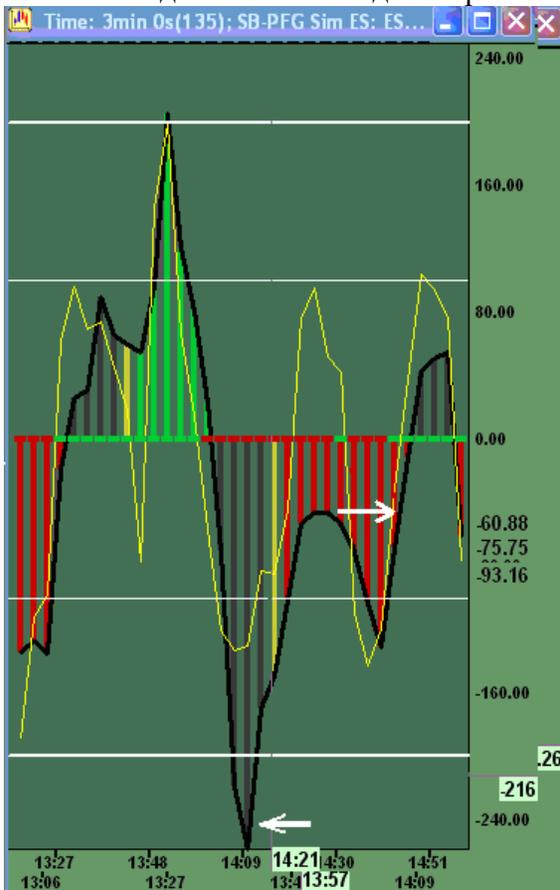


Рис. 19



Рис. 20

График 19 показывает VT против даунтренда.

График 20 показывает VT против аптренда.

Призрак (Ghost)

Призрак - контр-трендовый шаблон, который получил свое название от того, что на графике отрисовывается фигура, напоминающая привидение. Призрак включает в себя три пика по тренду. Средний пик выше, чем первый и последний. По двум провалам слева и справа от среднего пика рисуется так называемая "линия плечей". Как только CCI, сделав третий пик, пробивает "плечи", мы входим в трейд. Но, нельзя забывать, что этот шаблон торгуется против тренда, значит, чтобы его взять, нам потребуется подтверждение от LSMA. Заметим, что "линия плечей" может быть параллельна, направлена от или к ZL.

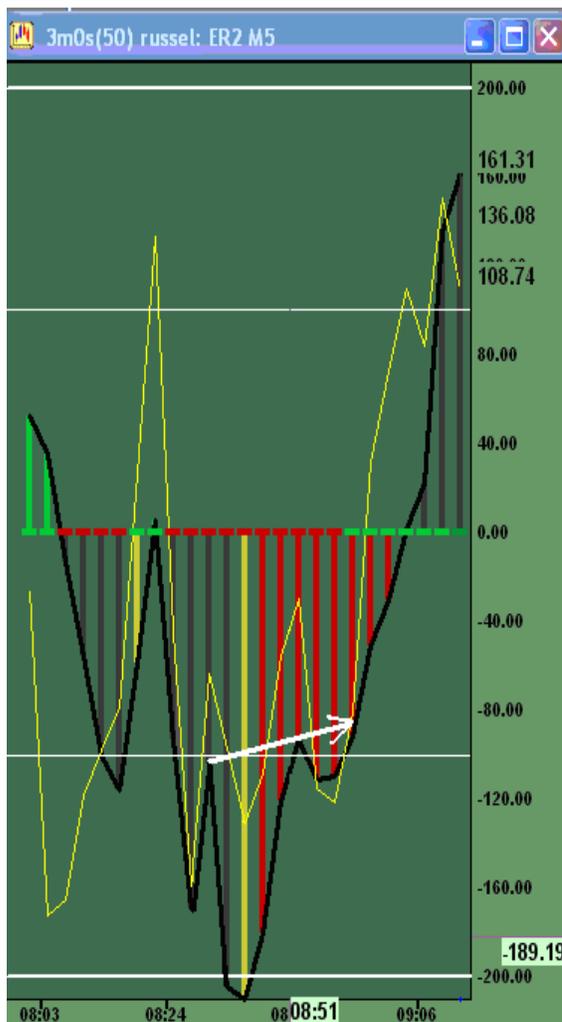


Рис. 21

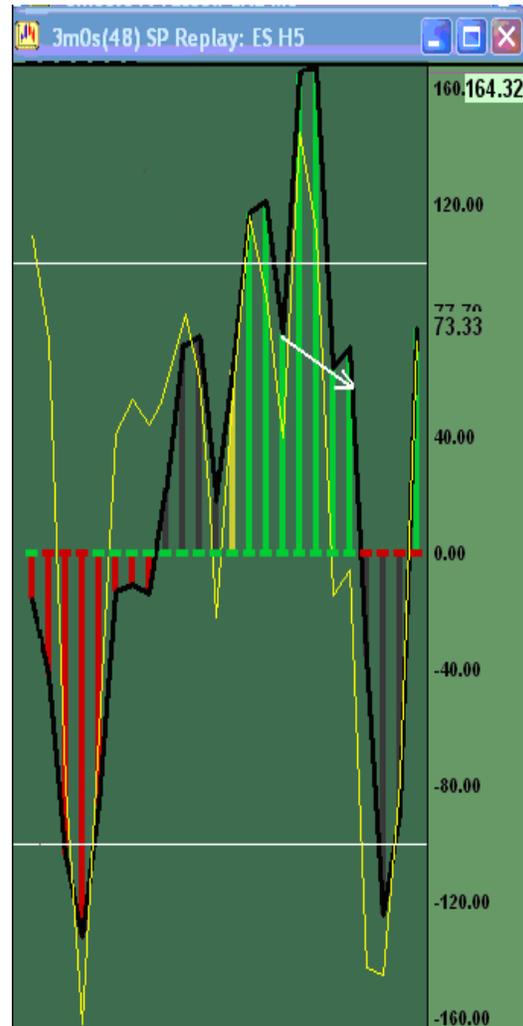


Рис. 22

График 21 показывает VT против даунтренда.

График 22 показывает VT против аптренда.

Крюк из экстремума (HFE)

Этот шаблон определить легче всего. Ранее мы разбирали эту фигуру в качестве сигнала к выходу. В роли противотрендового шаблона, HFE возникает, когда CCI выходит за пределы ± 200 и разворачивается по направлению к ZL. Это очень нестабильный шаблон, его лучше не использовать как самостоятельный сигнал входа в рынок. Обычно HFE предвещает сигнал от других контр-тренд шаблонов, таких как HTLB и TLB.

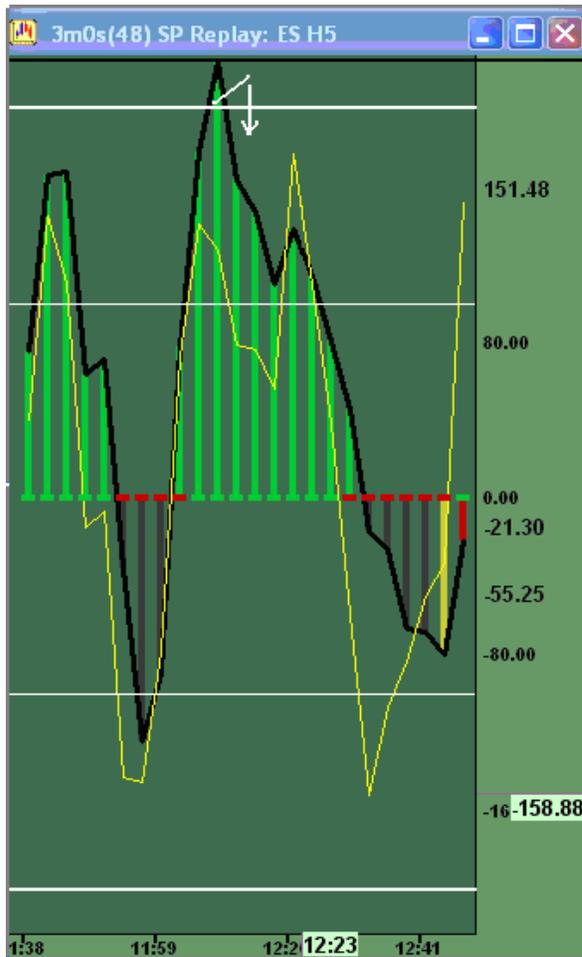


Рис. 23

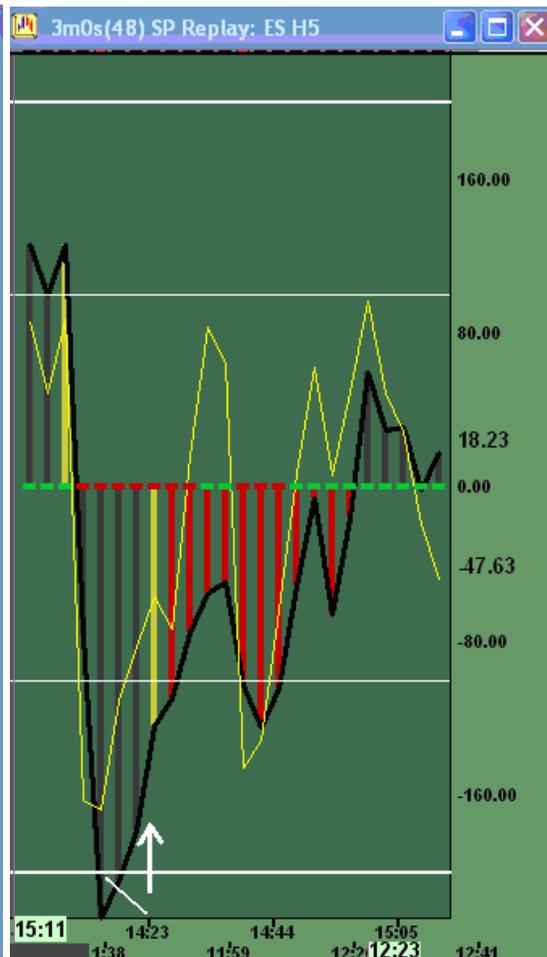


Рис. 24

TLB контр-тренд

Противотрендовый TLB строится абсолютно так же, как и обычный TLB. Разница заключается в том, что, после пробоя построенной нами линии, торговля ведется против текущего тренда.

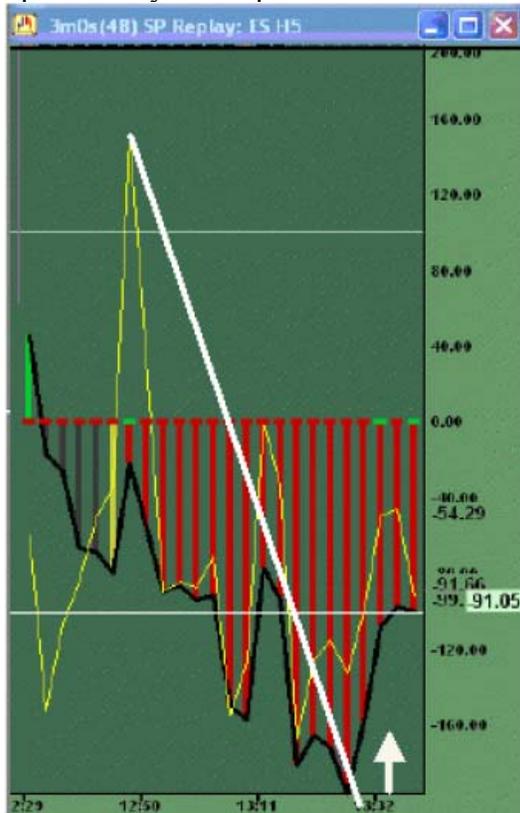


Рис. 25

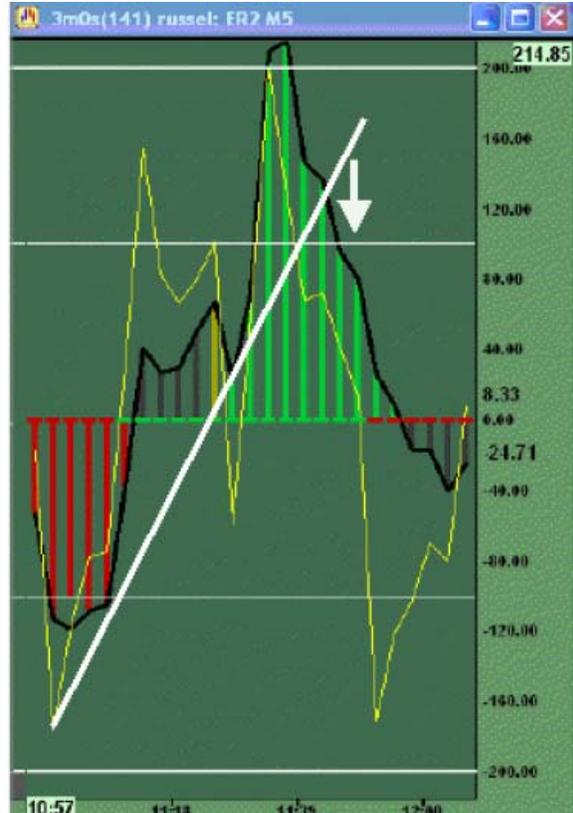


Рис. 26

График 25 показывает контр-трендовый TLB против даунтренда. На графике 26 изображен контр-трендовый TLB против аптренда.

В обоих приведенных примерах TLB следовал HFE. Это говорит о том, что сигнал достаточно силен. На 25 и 26 графиках линия тренда нарисована при помощи ТССИ. Некоторые трейдеры предпочитают использовать только ССИ, но применение ТССИ не возбраняется.

НТЛВ контр-тренд

И, наконец последний шаблон контр-трендовой торговли. Построение НТЛВ, так же, как и в предыдущем случае, не отличается от трендового собрата. Желательно подтверждение от других фигур смены тренда, как НФЕ. Чтобы получить хороший сигнал, фигура должна находиться в зоне +/- 100.

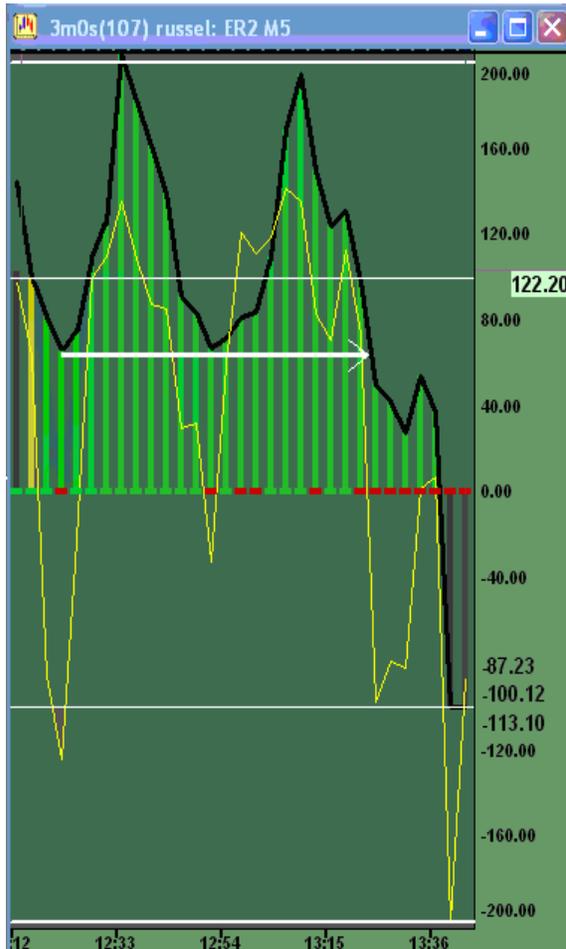


Рис. 27

Рис. 27 показывает сигнал на продажу



Рис. 28

Рис. 28 показывает сигнал на покупку

BESTDIRECT*fast*

Альянс компаний TradeMaven & PFG предоставляет трейдерам торговую платформу **BESTDIRECT***fast*. Эта платформа включает всё необходимое для анализа и торговли по системе **Woodie's CCI**:

Бесплатное (30 дней) Демо (симулятор) предоставляет полный доступ к Woodies графикам с исторической и реальной тик датой.

Для регистрации на бесплатное демо (симулятор), выйдете на www.pfg.ru/fastdemo - SIGN-UP NOW и заполните регистрационную форму

По всем вопросам обращайтесь:

Валерий Сигаев (Val Sigaev)

E-mail: vsigaev@pfgmail.com

Тел. 1-312-775-3496

If you have any questions about this text please send me an E-mail

joconnell@pfgmail.com

Jim O'Connell

Посетите русскоязычный сайт PFG <http://www.pfg.ru>