

Budowa zyskowych systemów transakcyjnych

(ISBN: 978-83-62429-04-2)

(Autor: Michał Dziejdz, Korekta: Marek Matuszek oraz Rafał Jaworski

Wydawca: Trader Team Sp. z o.o.)

Spis treści:

1. Wstęp
2. Dlaczego system?
3. Cele i warunki
4. Zarządzanie portfelem
5. Określenie podstaw systemu
6. Zbieranie materiału statystycznego (na podstawie danych historycznych)
7. Analiza zebranego materiału
8. Podsumowanie analizy i wdrożenie systemu na realnym rachunku

Wszelkie prawa zastrzeżone. Kopiowanie i rozpowszechnianie całości lub fragmentu niniejszej publikacji w jakiegokolwiek postaci jest zabronione.

Zgodnie z zaakceptowanym przez klienta **Wyłączeniem odpowiedzialności** związanej z ryzykiem, autor nie ponosi odpowiedzialności za działania podjęte po przeczytaniu i zastosowaniu „Budowa zyskowych systemów transakcyjnych”. Wszelkie pytania należy kierować na adres e-mail: benjamin.wadecki@wp.pl

Copyright 2012 © by Trader Team Sp. z o.o.



Trader Team

bo dla nas trading to coś więcej niż pasja...

biuro@traderteam.pl

www.traderteam.pl

1. Wstęp

Niewątpliwie wielu ludzi na świecie ma tendencje do poszukiwania własnego „złotego miasta”. Nikt nigdy nie udowodnił fizycznego istnienia Eldorado, natomiast panuje hipoteza, że istniało ono wyłącznie na poziomie mentalnym. I to właśnie mentalność „poszukiwacza” wyróżnia niektórych spośród tłumu zwykłych ludzi. Mit Eldorado jest chyba najlepszym porównaniem, jeśli chodzi o szukanie cudownych i nadzwyczaj zyskowych systemów. Chociaż to pierwsze jest tylko legendą, to drugie ma podstawy w rzeczywistości, choć na pewno są one mniej kolorowe, niż można to sobie wyobrażać. Otóż cudowne systemy nie istnieją, a mimo to są jednak takie, które przez jakiś czas mogą „gwarantować” określoną stopę zysku, co nie zapewni Ci Drogi Czytelniku zbitcia kokosów”, a jedynie umożliwi efektywniejsze pomnożenie Twoich oszczędności. Bo jak powszechnie wiadomo, pieniądz robi pieniądz. Mogą to potwierdzić ci, którzy na co dzień tradują, a czego z pewnością nie powtórzą ludzie trzymający swój kapitał na lokatach. Również fundusze nie są z reguły optymalnym rozwiązaniem dla tych, którzy w każdym momencie chcą mieć rękę na pulsie i pragną posiadać całkowitą kontrolę nad swoimi zasobami. Większość funduszy inwestycyjnych oferujących długoterminowe plany oszczędnościowe, zakładają że deponowaną przez inwestora gotówkę można będzie bez straty odebrać dopiero po upływie kilku, jeśli nie kilkunastu lat. Wielu przedstawicieli oferujących fundusze różnych firm, to młodzi ludzie ubrani w garnitury, którzy w życiu nie zainwestowali na giełdzie ani złotówki, a pouczają szarych obywateli, gdzie mają lokować swoje pieniądze. Oczywiście nie neguję tu sensu istnienia funduszy inwestycyjnych, gdyż jak najbardziej mogą one przynieść wiele korzyści, jednak dla tych, którzy pragną większej wolności w inwestowaniu, jedyną słuszną

drogą jest poszukiwanie własnych systemów i strategii oraz ich późniejsze optymalizowanie.

Powstało już wiele opracowań na temat tworzenia systemów transakcyjnych. Są to bardzo pomocne i wyjaśniające wiele spraw prace. Jednak w swoim e-booku zamierzam podjąć się omówienia tej kwestii w nieco niestandardowy sposób.

Jeśli należysz do ludzi mających pasję szukania, wynajdywania i udoskonalania systemów transakcyjnych na rynkach walutowych, futures lub akcji, to właśnie czytasz publikację, która powinna Cię zainteresować, przy czym mam nadzieję, że jej zawartość w dużym stopniu przyczyni się do osiągnięcia przez Ciebie zysków w przyszłości.



2. Dlaczego system?

W tym punkcie warto sobie odpowiedzieć na pytanie, jakie czynniki składają się na sukces każdego tradera/inwestora. Jednym z nich jest perfekcyjne opanowanie własnych emocji. Można by rzec, że tę sztukę najlepiej posiadli buddyjscy mnisi, więc powinni pławić się w luksusie, lecz akurat nie w tym rzecz. Trudność polega na tym, że podstawą samokontroli jest właśnie określony „system”. Nie chodzi tu o zwartą formułę, czy wzór, lecz o drogę postępowania w każdym momencie pobytu na rynku. Tylko w takich warunkach można wyeliminować emocje i kierować się chłodnymi kalkulacjami.

Zachowania rynku są nieprzewidywalne, w związku z czym nie warto tracić czasu na prognozowanie. Wiele razy uda Ci się przewidzieć, w którą stronę podaży rynek, jednak często będzie to wynik zwyczajnego rachunku prawdopodobieństwa, a nie Twojego doświadczenia i wiedzy. Jest to powód, dla którego każdy potrzebuje jakiegoś planu gry, planu zawierania transakcji. Kiedy rzucasz się w wir inwestowania „na gorąco” (bez strategii), to tak jakbyś skakał ze spadochronem nad pustynią i nie miał ze sobą ciśnieniomierza. Nie będziesz wiedział, kiedy pociągnąć za linkę –naturalnie możesz mieć szczęście i wtedy zrobisz to za wysoko lub na dobrej wysokości, ale co się stanie, jeśli będziesz za nisko? Podobnie jest z inwestowaniem! Otwierając pozycję za pozycją, nagle spostrzegasz, jak Twoje transakcje zaczynają przynosić straty – 5, 10, 15%... gdyż nie mając planu, działamy pod wpływem chwili. W takiej sytuacji możesz je zamknąć i tym samym uciąć straty, możesz też poczekać, aż rynek odbije. Jednak cokolwiek byś robił, to w danym momencie tracisz i nie wiesz, jak z tego wybrnąć. Nagle widzisz, jak Twój rachunek zmniejsza się do 70%, zamykasz wszystkie pozycje i otwierasz jedną

za maksymalną ilość środków, zostawiając niewielki margines. Co się może się wydarzyć dalej? Jak się okazuje, inwestorzy najczęściej w takiej sytuacji zaczynają podejmować wszelkie kroki w celu odegrania się. Niezależnie od wyniku, przy takim podejściu zawsze będziesz kręcił się jak błędny rycerz, a podbramkowe sytuacje będą dla Ciebie chlebem powszednim.

Tak na ogół wygląda gra bez planu. Pamiętaj, że system da Ci odpowiedź na każdą sytuację, w której się znajdziesz. Jeśli go nie masz i szukasz odpowiedzi na szybko, nie mając czasu na analizowanie tego, czy dana decyzja w dłuższym terminie będzie korzystna, czy też nie, to podobnie jak w pokerze, nie będzie liczył się chwilowy wynik rozgrywki. Znaczenie ma tylko ilość podjętych właściwych decyzji. A wiedzę o tym, czy decyzja była zła, czy dobra, można zdobyć, jedynie mając oszacowane pewne wartości, o czym będzie mowa w dalszej części opracowania, jednak specjalnie dla niecierpliwych i tak przedstawię pewien wstęp już w tym rozdziale.

Najlepszym przykładem podejmowania złych decyzji jest gra w ruletkę. Obojętnie, co obstawiasz, to prawdopodobnie w końcowym rozrachunku oddasz swoje pieniądze kasynu. Gdybyś codziennie przychodził do kasyna i stawiał 100 PLN na czarne/czerwone, parzyste/nieparzyste lub wysokie/niskie - Twoje szanse wygranej będą równe 18 z 37, czyli 48,6% (w amerykańskiej ruletce, gdzie są dwa zielone pola, jest 47,4% szans na wygraną).



Matematyczny zapis będzie wyglądał mniej więcej tak:

$$0,486*100+0,514*(-100)=-2,8$$

Na sto takich samych zakładów 280 PLN trafi w ręce kasyna.

Analogicznie jest z rynkiem. Jeśli ryzykujesz np. 30 pipsów dla 60, to Twoje szanse zysku powinny być powyżej 33%, inaczej w długim okresie uzyskasz wynik równy zero lub stracisz. Nie liczę w tym przypadku oczywiście straconego czasu. Warto również zauważyć, że w krótkim okresie wariancja może nieco zaburzyć szacowane wyniki. Jednak gdy Twój system generuje odpowiednią liczbę rentownych sygnałów, szybko ucinasz straty, a zyskom pozwalasz rosnąć lub dobrze je zabezpieczasz, to znajdujesz się wtedy w zupełnie odwrotnej sytuacji, niż osoby grające w ruletkę.