

Automatisering Money Management analoog aan R-ladder in Sierra Bertram The v1.0

Anmaken van de parameters in 'Trade' -> 'Trade Window for Chart':

		<p>Links: Kies tab 'main'. Vinkje bij 'use attached orders' Order type = Stop Quantity = 3</p> <p>Rechts: Kies tab 'targets'</p>
		<p>Links: Target 1 limit offset = 1R (in dit voorbeeld 20 ticks)</p> <p>Rechts: Stop 1 = -1R (in dit voorbeeld ook 20 ticks)</p> <p>Dit is OCO Group 1 (twee gekoppelde orders: zodra 1 vd 2 wordt getriggerd, wordt de andere order gecancelled. In dit geval: als target 1 wordt gehaald, wordt stop 1 gecancelled en andersom.)</p> <p>Om OCO Group 2 te definiëren, druk je op 'Add'</p>
		<p>Links: Target 2 = 2R (hier 40); vul dit weer in in het vakje 'limit offset'</p> <p>Druk nogmaals op 'Add'</p> <p>Rechts: In tegenstelling hiervoor willen we dat voor dit 2e contract het stop loss niveau automatisch wordt aangepast, als de koers steeds verder oploopt. - Kies dus order type 'stop: triggered step trail stop'. - Stop offset = 1R (hier 20); dit is de initiële stop na trigger vd stop buy / sell (dus zodra de contracten geopend worden). Er worden dus 3 initiële contracten aangemaakt die allen hetzelfde initiële stop loss niveau hebben, terwijl de koersdoelen oplopend zijn. - Trail offset = 1R (minimale afstand tussen koers en stop loss) - Trigger offset = 1R (het trailing mechanisme wordt getriggerd op 1R) - Step amount = 0.5R (het stop loss niveau wordt steeds met stappen van 0.5R bijgetrokken)</p>
		<p>Links: Als je nog een keer op 'Add' hebt gedrukt kun je target 3 definiëren. Deze zetten we nog iets verder weg, dan target 2.</p> <p>Druk weer op 'add'.</p> <p>Rechts: Ook nu wordt een order type 'triggered step trail stop' gedefinieerd. We gebruiken exact dezelfde input zoals voor contract 2.</p> <p>NB: Via de knop 'M' onder het tabje 'main', kun je kiezen voor 'safe configuration'. Zo kun je meerdere basisconfiguraties opslaan waarbij het risico bv 10, 20, 40, etc punten bedraagt.</p>



Voorbeeld toepassing:

'Trade' -> 'Chart trade mode' = on.

Links:
Bepaal je koersdoelen.

Rechts:
Bepaal je risico.
In dit voorbeeld gebruik ik hiervoor een retracement tool (aangepast via 'tool' -> 'tools configs' -> 'price retracement' -> 'options' -> 'show points').

Uitname van de bottoming tailbar wordt de trigger, zodat het risico op minimaal 37 punten komt.

Links:
Kies de juiste configuratie (R40 is de configuratie met risico van 40 pnt)

Rechts:
Geef de order (in dit voorbeeld een Stop Buy order met de rechter muisknop via de chart vlak boven de bottoming tailbar).



Links:
Je ziet nu het entry niveau (groen) met daaronder het initiële stop loss niveau.

Daarboven zie je 3 koersdoelen, die je kunt verslepen.

Rechts:
- Koersdoel 3 delete ik (kruisje), want het laatste contract wil ik blijven trailen tot hij wordt uitgestopt.
- Koersdoel 2 heb ik hier op de swing high gezet
- Koersdoel 1 sleep ik ook iets omhoog



Verloop van dit MM-systeem (voorbeeld zonder koersdoelen te verslepen; 1R = 20 pnt hier; in stapjes van 10 pnt wordt de trailing stop steeds op 20 pnt van het koersdoel gezet):

Links:
identiek stop loss niveau voor de 3 contracten
3 koersdoelen

Rechts:
delete het 3e koersdoel (want deze willen we blijven trailen zonder maximum koers)



Links:
Stop Sell getriggerd op 13370
Er zijn nu 3 contracten actief.
Stop loss op 13390 (want 1R = 20 pnt)

Rechts:
Koersdoel 1 is gehaald. 1 Contract afgesloten.
2 Contracten over.
Stop loss verschuift automatisch voor beide op 0R.

Minimale winst is dus 1/3R, ook als de overige 2 contracten ook binnenkort de stop loss raken.

		<p>Links: Koers zakt voorbij 13340 (1.5R), dus stop loss wordt automatisch verschoven naar 13360 voor beide overgebleven contracten.</p> <p>Minimale winst is nu $1/3R + 1/6R + 1/6R = 2/3R$</p> <p>Rechts: Koers haalt bijna Koersdoel 2.</p>
		<p>Links: Koersdoel 2 behaald. Het 2e contract wordt automatisch afgesloten. Geborgde winst is nu $1/3R + 2/3R + 1/3R = 1 1/3R$</p> <p>Er is nog 1 contract over.</p> <p>Rechts: De koers zakt voorbij 13320. De stop loss wordt automatisch naar 13340 verplaatst.</p>
		<p>En zo gaat het door, totdat het laatste contract op 13270 wordt uitgestopt:</p> <p>Het laatste contract heeft dus bijna 6R behaald en is op 5R nu uitgestopt.</p> <p>Mooie trade!</p>

NB:

- Het verslepen van de stop loss niveau's heeft geen invloed op de wijze van trailing. Het is dus beter om meerdere configuraties te hebben (zoals hier gedemonstreerd in een configuratie met 20 punten risico versus 40 punten risico). Op deze wijze is de wijze van trailing beter aangepast aan de grote van het risico en volatiliteit.
- Het verslepen van de koersdoelen kan juist wel zonder ongewenste bijeffecten.

- De stop loss / koersdoelen worden in 'tick sizes' gegeven. De DAX gebruikt bv een tick size van 0.5 - dat betekent dat je dan kiest voor een factor 2 grotere offset. (Zie je uiteraard direct in de chart, dus zou geen probleem moeten zijn).

- Dit is een eerste poging voor automatisering van een MM-systeem, geen handleiding van een time-tested methode. Dit hoort in de categorie Sierra Charts Van Beginners Voor Beginners.