

# **Системный подход в торговле**

**Бабушкин Дмитрий**

**«ЭЛТРА»**



# Технический анализ

- Фундаментальный анализ определяет куда направятся деньги, но не отвечает когда.
- Технический анализ констатирует, что финансовый поток пришел или его нет и определяет направление входа и наилучшую ситуацию для этого.
- Изучает состояние рынка в вопросе баланса спроса и предложения.
- Метод статистической обработки исторических данных.



# Виды торговых стратегий

## ПО ХАРАКТЕРУ СТРАТЕГИИ:

- **Трендовые**
- **Контр-трендовые**

## ПО ВРЕМЕНИ УДЕРЖАНИЯ:

- **Скальперские** – от нескольких секунд до 10-15 мин.
- **Внутридневные** – от часа до конца торгов
- **Краткосрочные** – 1-2 недели
- **Среднесрочные** – от нескольких недель до нескольких месяцев
- **Долгосрочные** – от нескольких месяцев до года
- **Инвестиционные** - от года



# Методы торговли на бирже

## ➤ Интуитивный подход

- Трудность анализа ошибок
- Не возможность тестирования стратегии на истории
- Не качественные точки входа
- Психологические стрессы и ловушки

## ➤ Системный трейдинг

- Механические торговые системы
  - Отключается психология
- Автоматические торговые системы
  - Арбитражные роботы
  - Торговые роботы

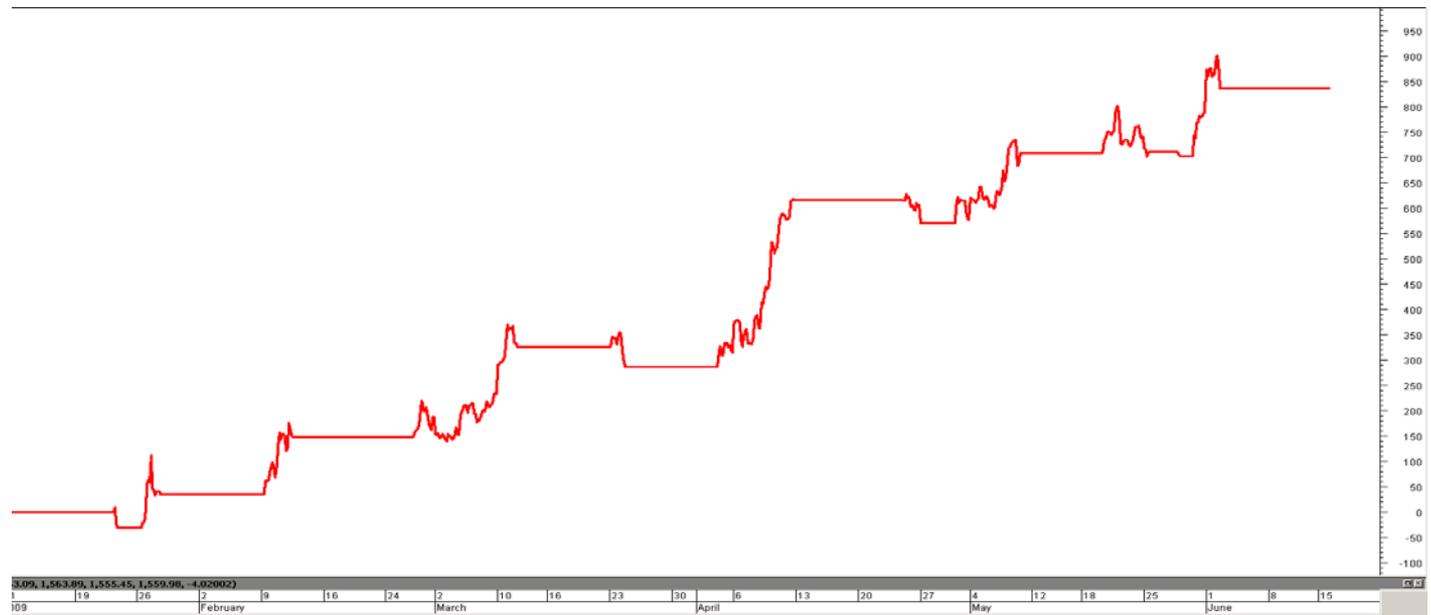


# Тестирование торговой системы

- Количество завершённых сделок более 30, лучше 70-100
- Максимальная прибыль/убыток за одну сделку – просадка
- Максимальный убыток – просадка счёта
- Средняя прибыль/убыток – устойчивость
- Отношение количества прибыльных и убыточных сделок – устойчивость
- Максимальная прибыльная/убыточная серия – стоп по одной сделке и стоп-аут



# Кривая доходности



# Дневник трейдера

- Ошибки :технические и психологические
- План дневника:
  - Причины и цена входа
  - Ожидаемая цель и развитие рынка
  - Вспомогательная система профита
  - Точка ожидаемого стопа и причины
  
  - Реальная цена выхода и причины
  - Вывод о результатах входа



# Задачи новичка

- Достижение торговой дисциплины
- Накопление знаний и опыта
- Разработку положительной торговой стратегии: описание рынка, система входа, профита, стопа
  - Время, которое трейдер готов уделять для анализа и контроля рисков
  - Психологическая предрасположенность к риску
- Стабильность роста торгового счета



# Компоненты торговой системы

- Определение ситуации и ее развития
- Определение методики входа
- Определение методики выхода
  - Стоп
  - Профит



# Система входа

- Индикаторный
- Графический



# Система выхода

- Стоп – выход по убыткам
  - По убыткам
  - Графический (пробой макс/мин)
  - Индикаторный. (обратное пересечение)
  - Следящий
- Стоп-Аут – остановка в работе по убыткам или негативным событиям
- Профит – фиксация прибыли
  - При достижении ценового уровня
  - При достижении процента движения
  - Индикаторный
  - Следящий



# Определение ситуации и ее развития

- Активный тренд
- Слабый тренд
- Разворотная ситуация
- Боковое движение
- Мертвая зона



# Используемые индикаторы

- **Скользящая средняя** - усредненное за определенный период значение цены базового актива
- **Bollinger Bands** – ленты, удаленные от средней на определенную величину СКО
- **ADX.**- определяет значимость тренда. Если более 30, то тренд значим
- **OBV** – объемный индикатор, если цена закрывается выше цены закрытия предыдущего периода то объем за период прибавляется, если ниже вычитается
- **MACD** – разница средних с разным временным периодом
- **CCI** – осциллятор, используемый для входа. (уровни -200, -100, 0 ,100,200)

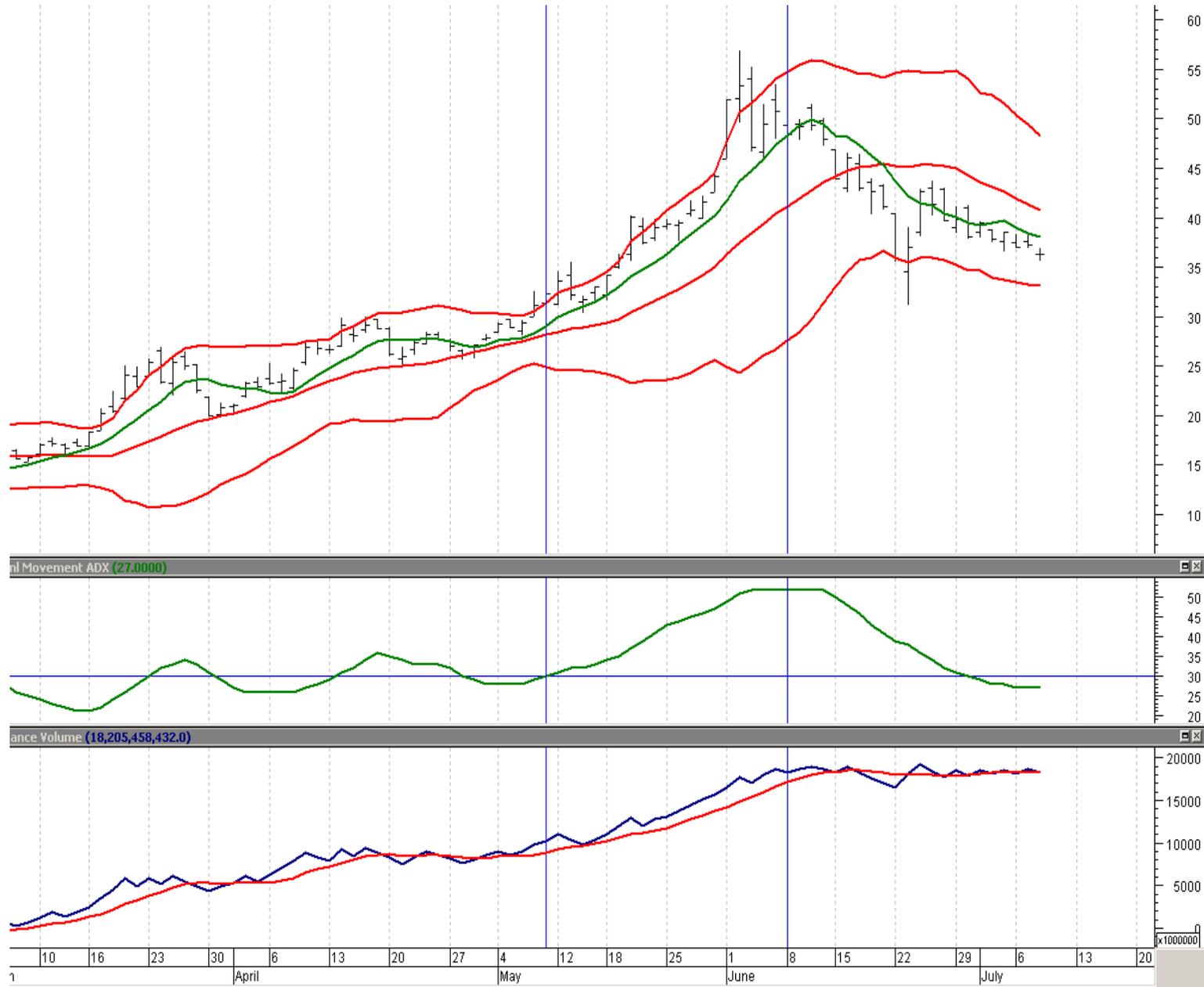


# Активный тренд

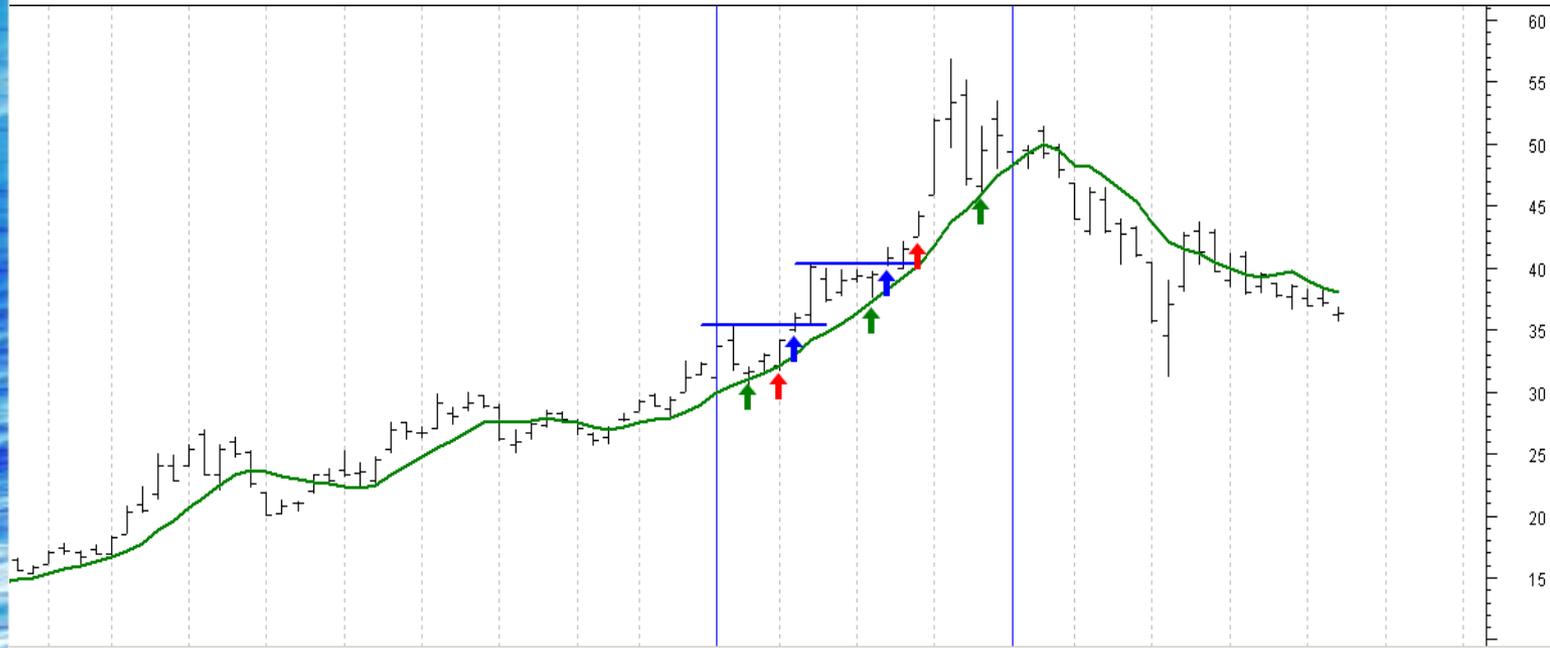
- Устойчивое направление
- Высокой скоростью движения
- Всплеском волатильности
- Ростом направленных объемов
- Конвергенцией осцилляторов



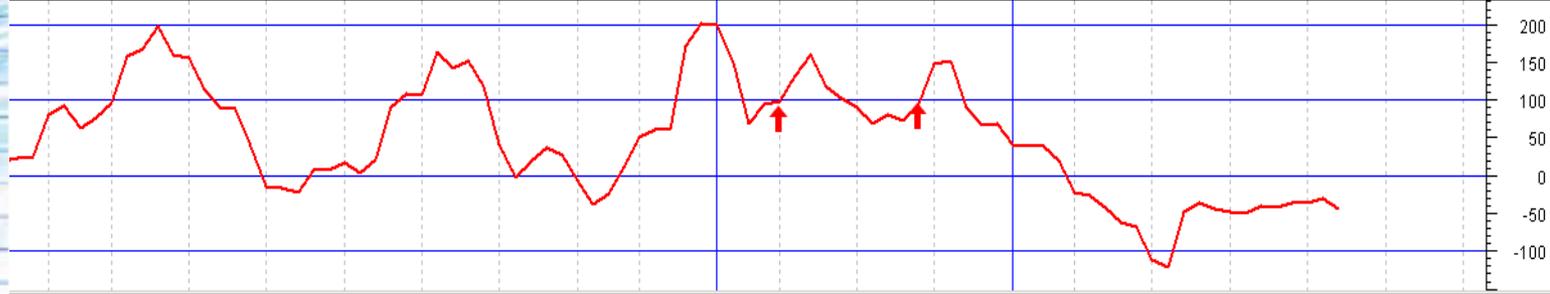
# (Дневник, активный тренд)



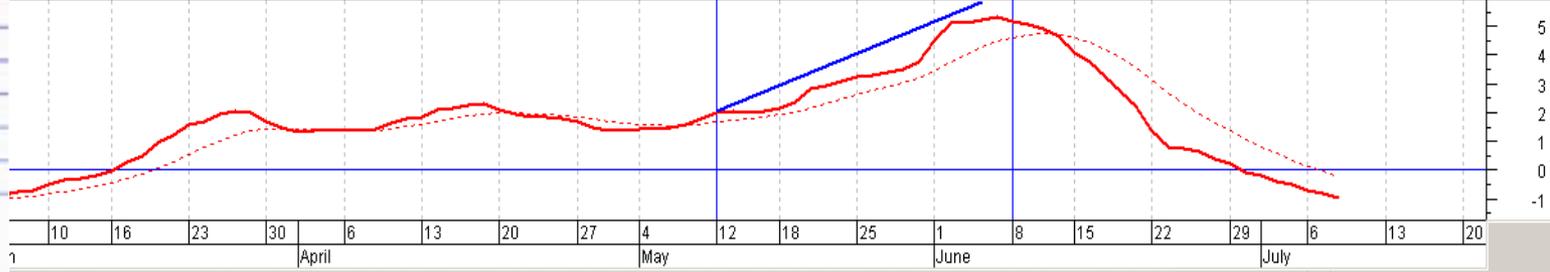
# (Дневник, активный тренд)



uis (-43.1201)



(-0.99194)

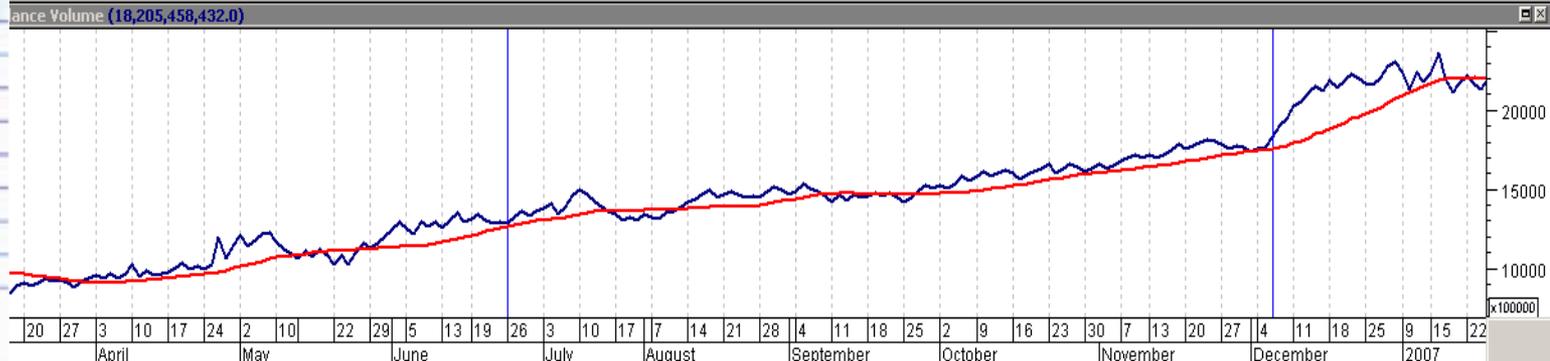
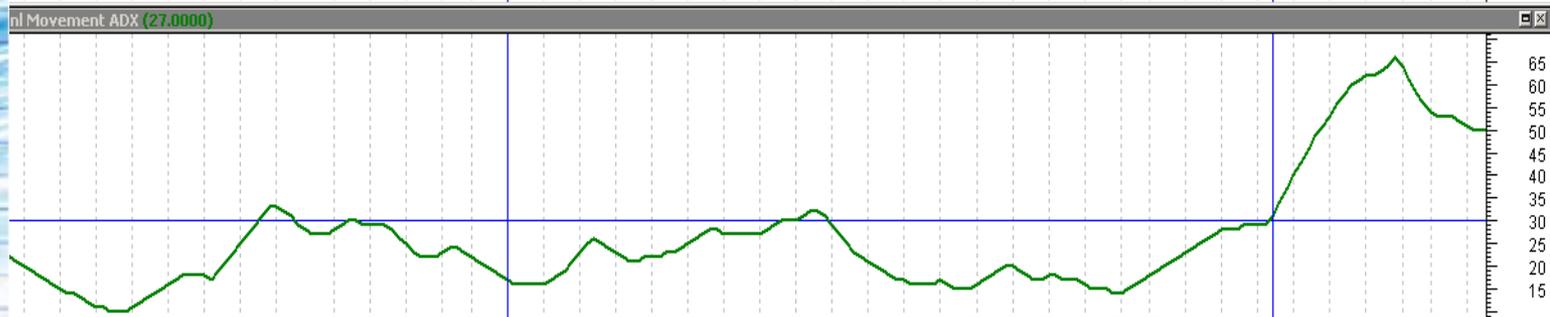
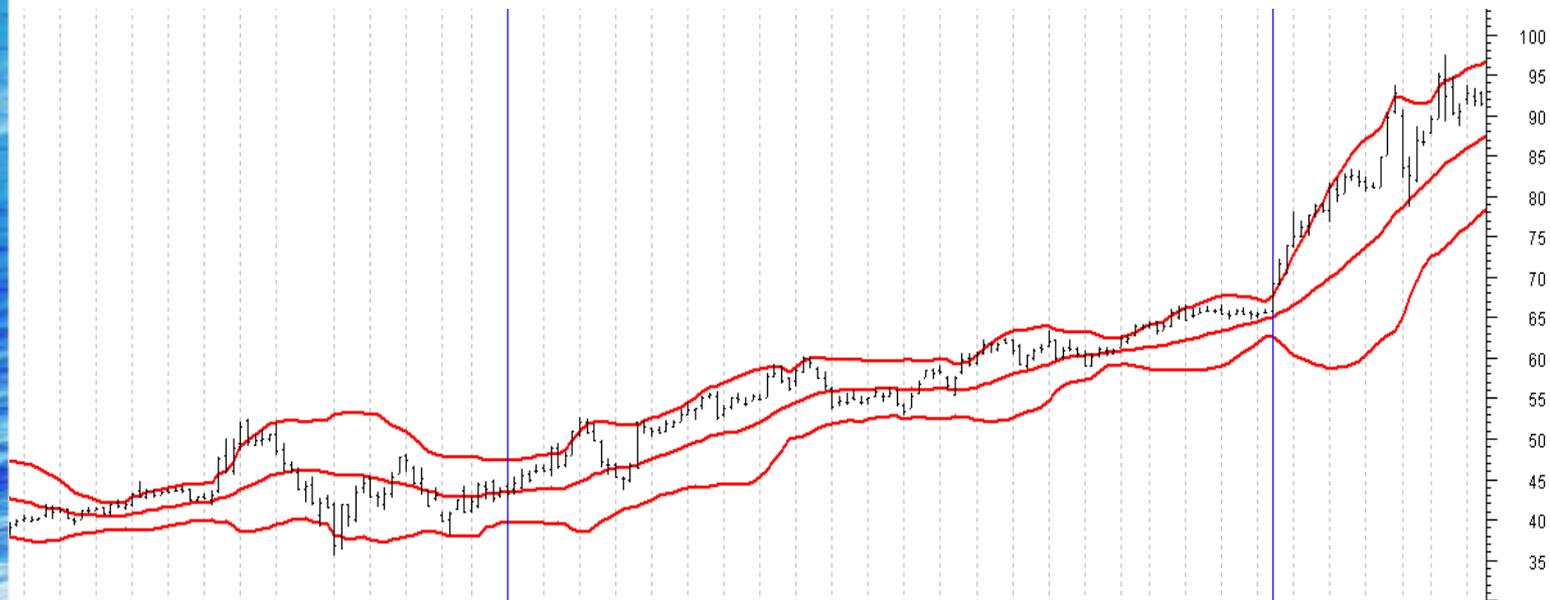


# Слабый тренд

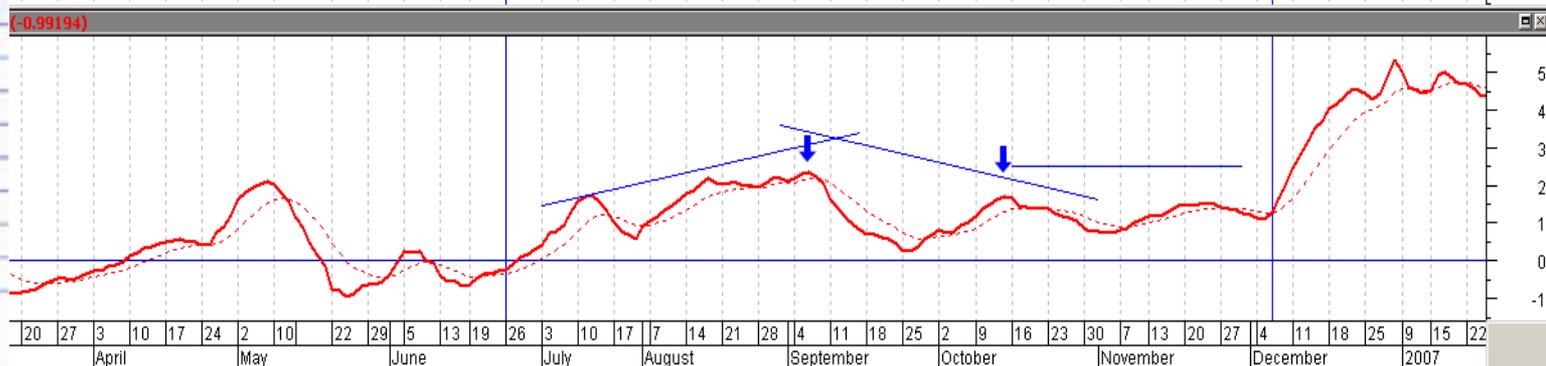
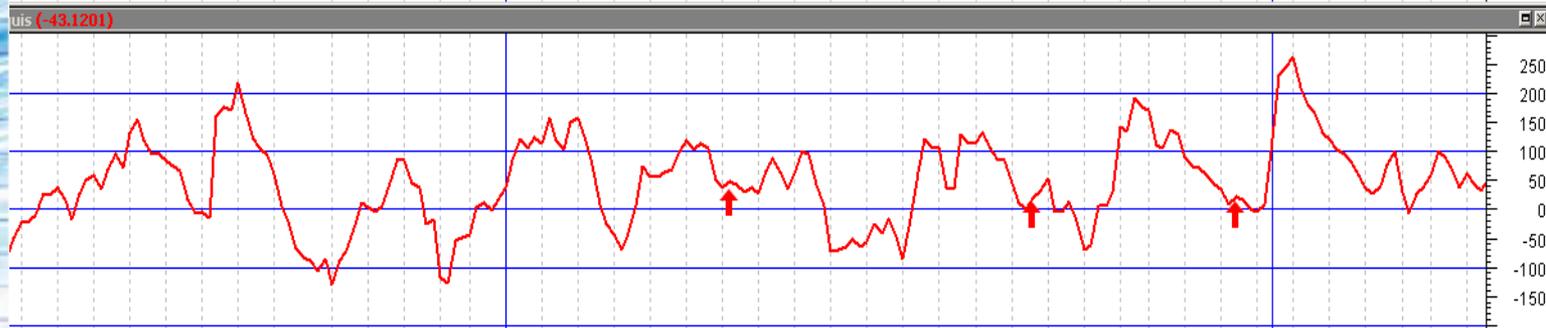
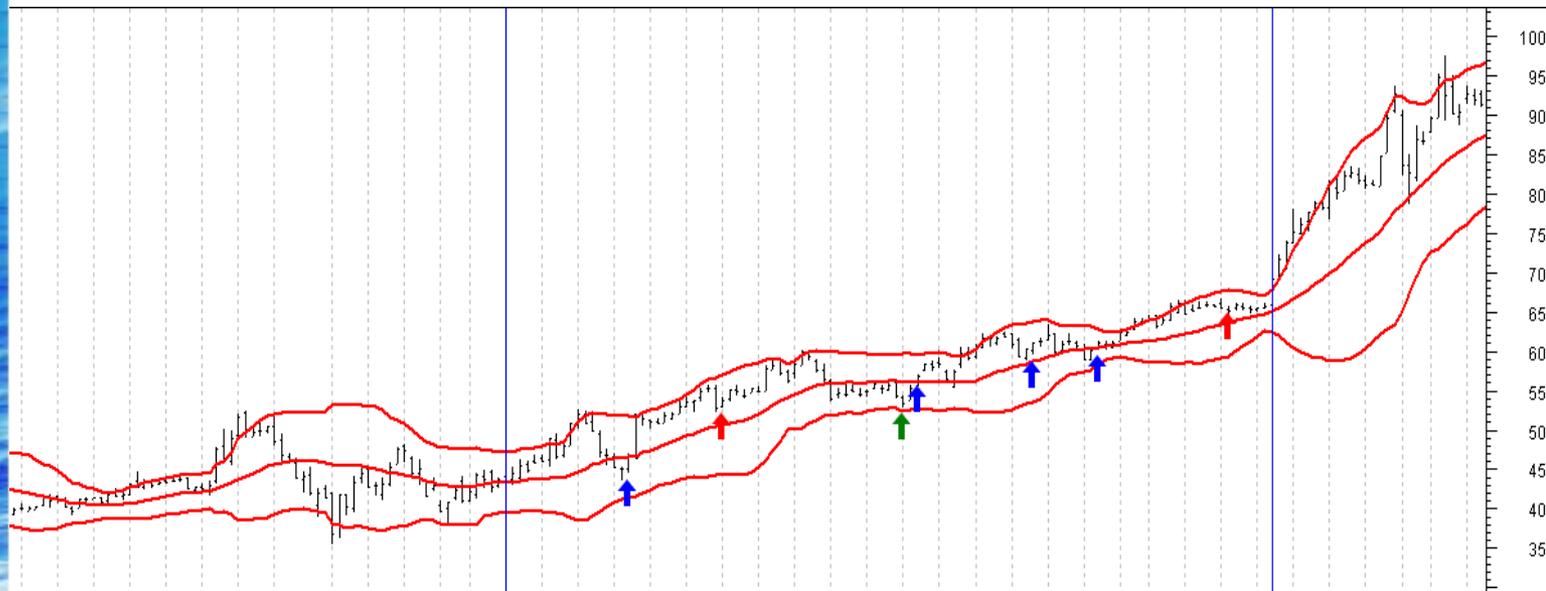
- Наличие направления, в т.ч. при слабых коррекционных отскоках
- Низкой скоростью
- Средней волатильностью
- Низкой скоростью накопления объемов
- Осцилляторы могут быть и в конвергенции и в дивергенции, тогда локальный откат может быть сильнее



# (Дневник, тренд)



# (Дневник, тренд)



20 27 3 10 17 24 2 10 22 29 5 13 19 26 3 10 17 17 14 21 28 4 11 18 25 2 9 16 23 30 7 13 20 27 4 11 18 25 9 15 22  
April May June July August September October November December 2007

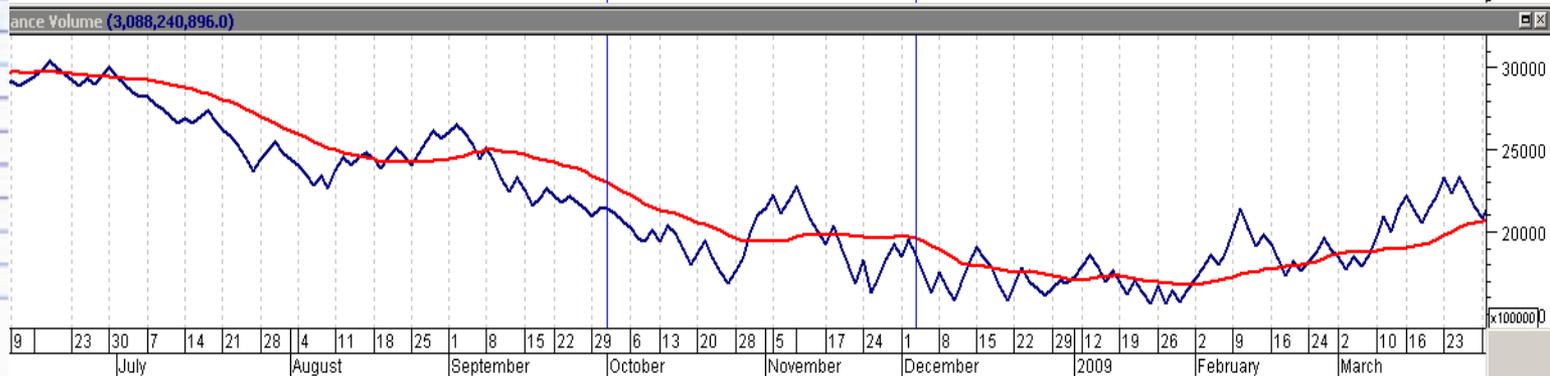
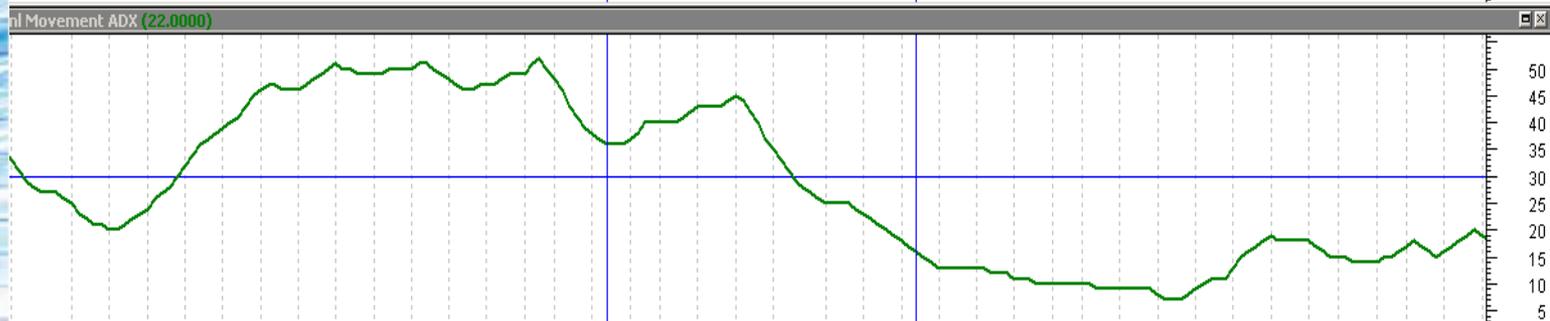
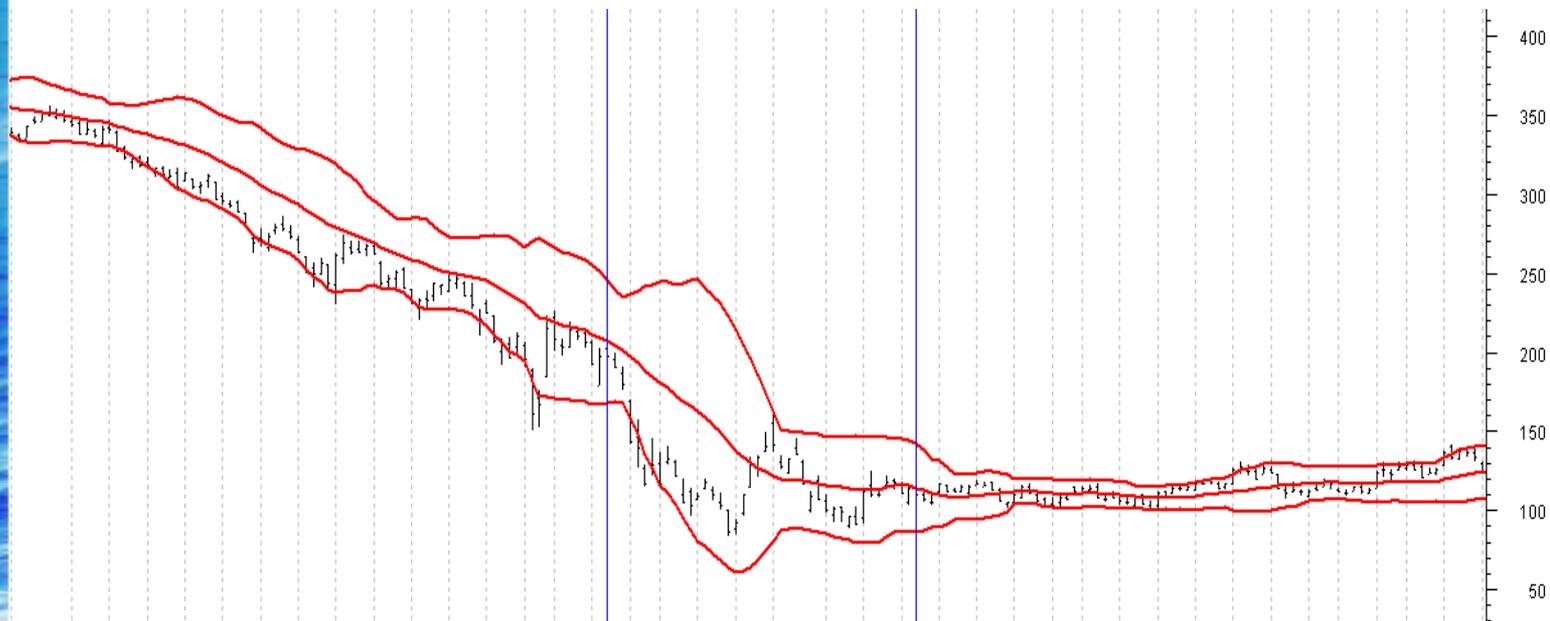


## Разворотная ситуация

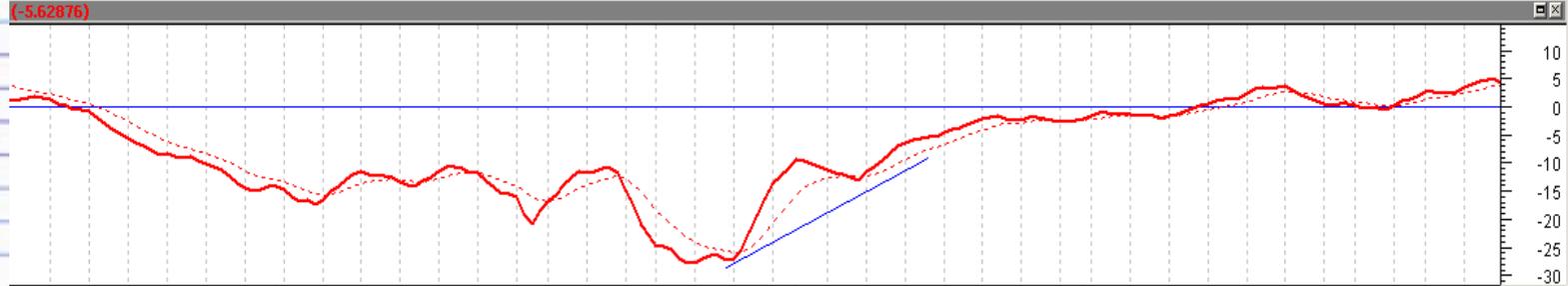
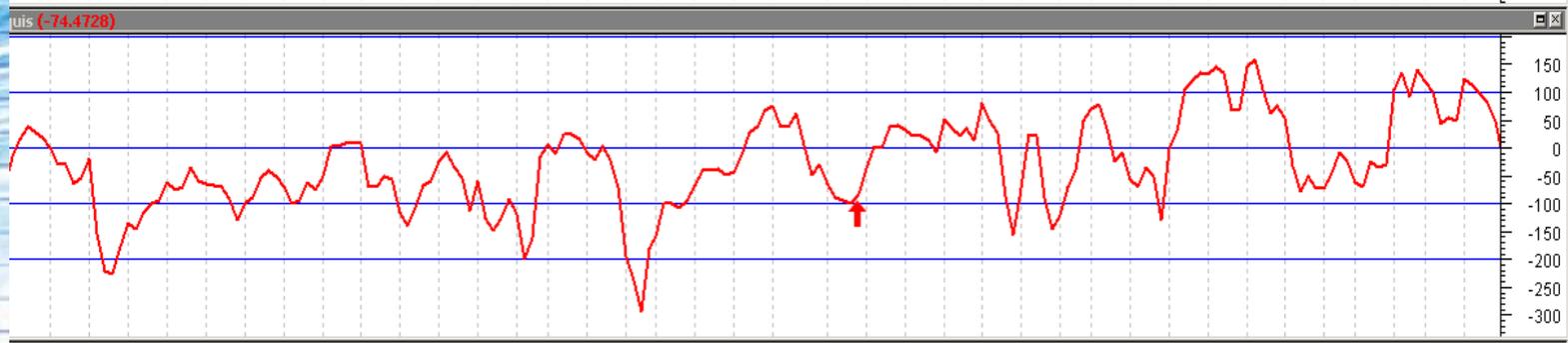
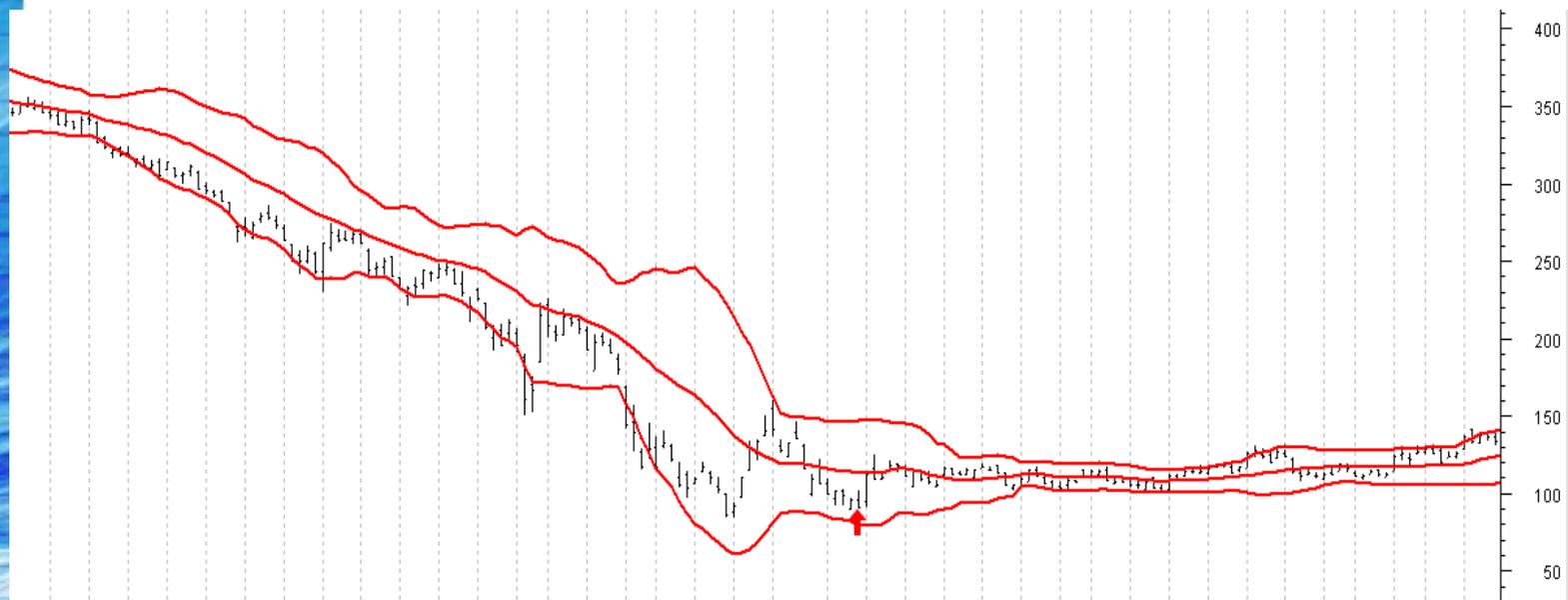
- Наличие направления, но может определяться и боковик
- Дивергенцией объемов и цен или дивергенцией скорости накопления объемов и показателя
- Снижение волатильности накопления направленных объемов
- Снижение волатильности цен
- Дивергенцией осцилляторов



# (Дневник, разворот)



# (Дневник, разворот)



23	30	7	14	21	28	4	11	18	25	1	8	15	22	29	6	13	20	28	5	17	24	1	8	15	22	29	12	19	26	2	9	16	24	2	10	16	23
July			August				September				October				November			December			2009			February			March										

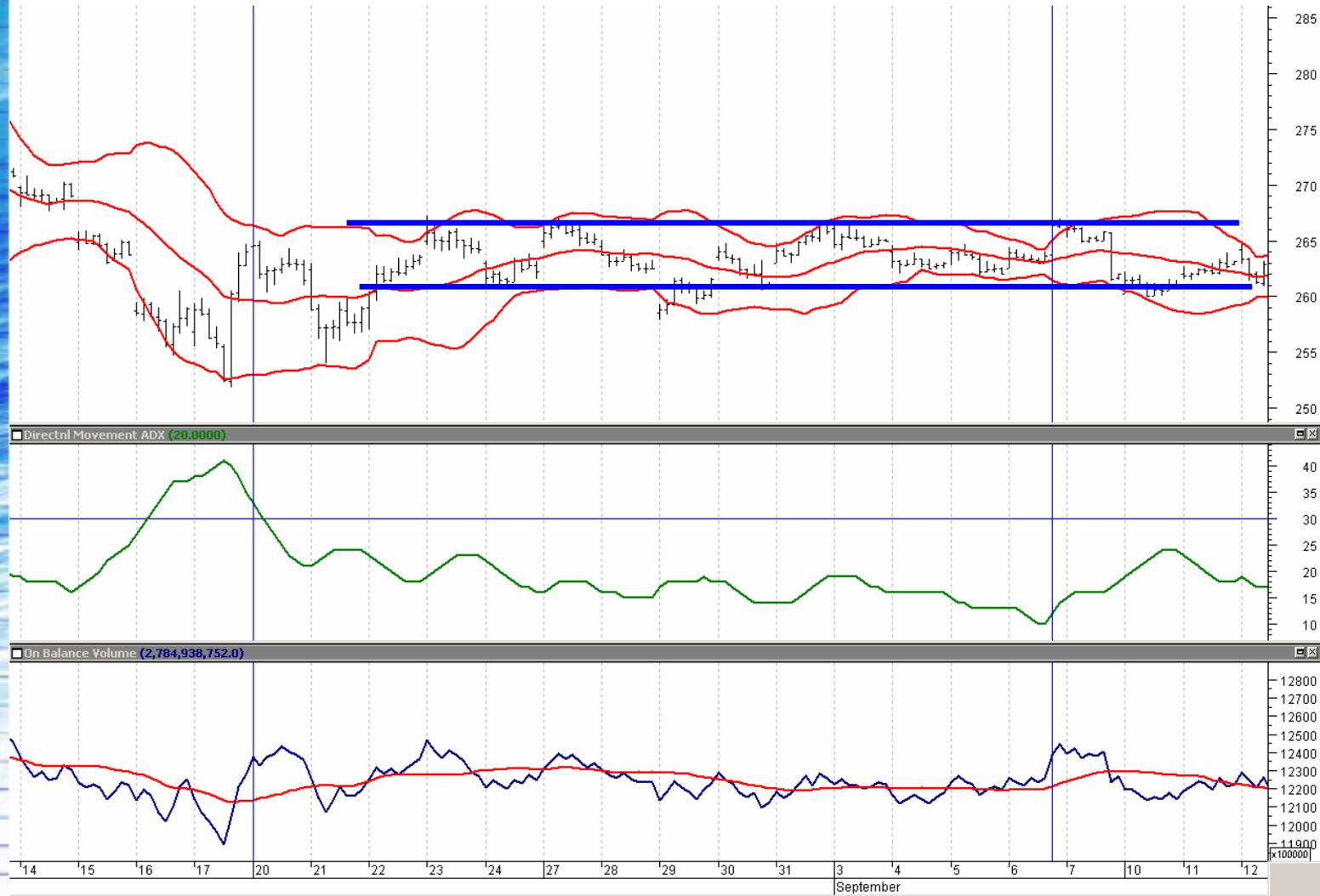


# Боковой тренд

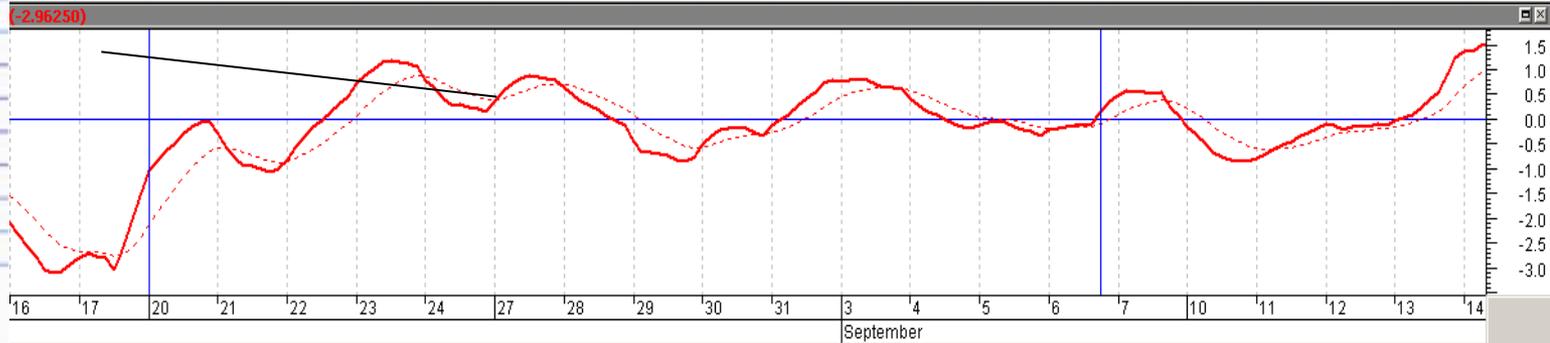
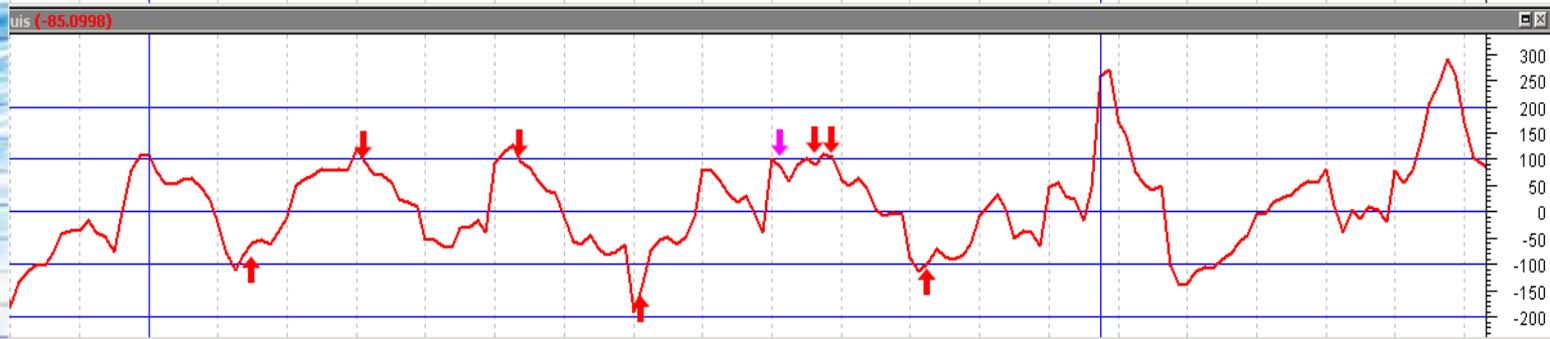
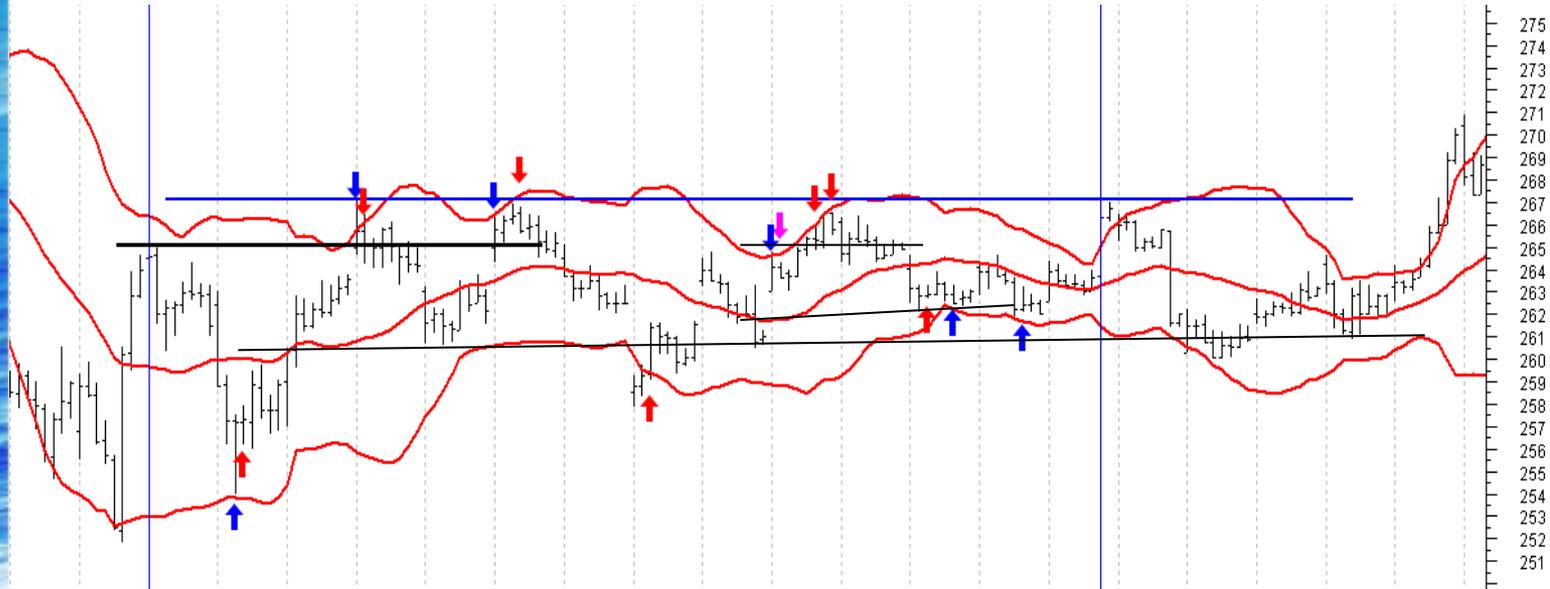
- Отсутствием направления
- Образование сильных уровней поддержки/сопротивления
- Низкой или средней волатильностью цен
- Отсутствием направленных объемов
- Низким уровнем волатильности направленных объемов



# (Часовик, боковой тренд)



# (Часовик, боковой тренд)



# Мертвая зона

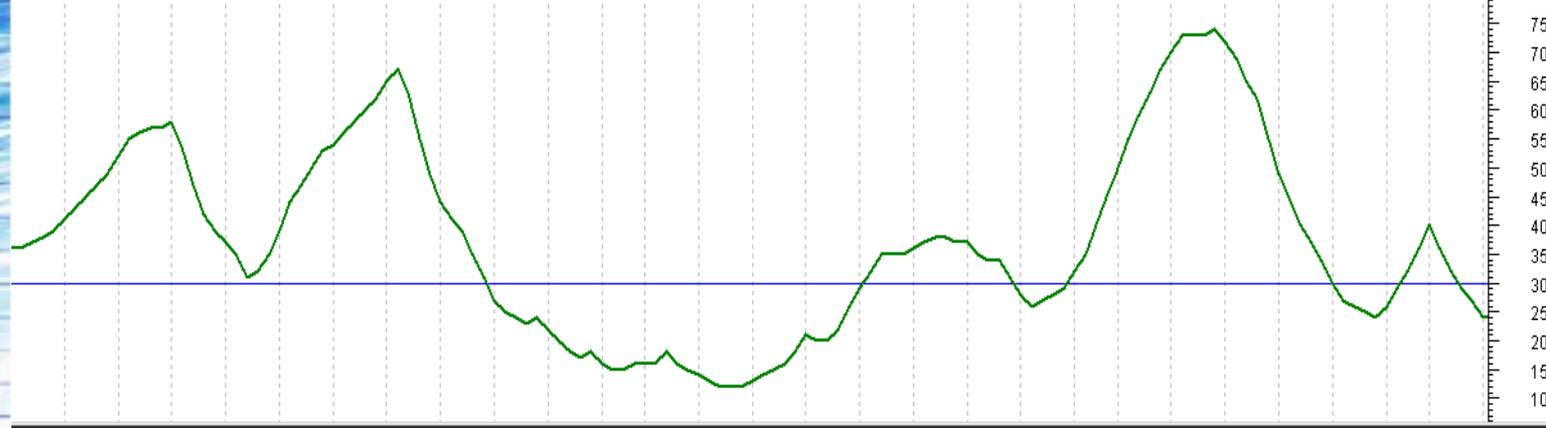
- Отсутствие волатильности цен
- Отсутствие волатильности направленных объемов и объемов в принципе



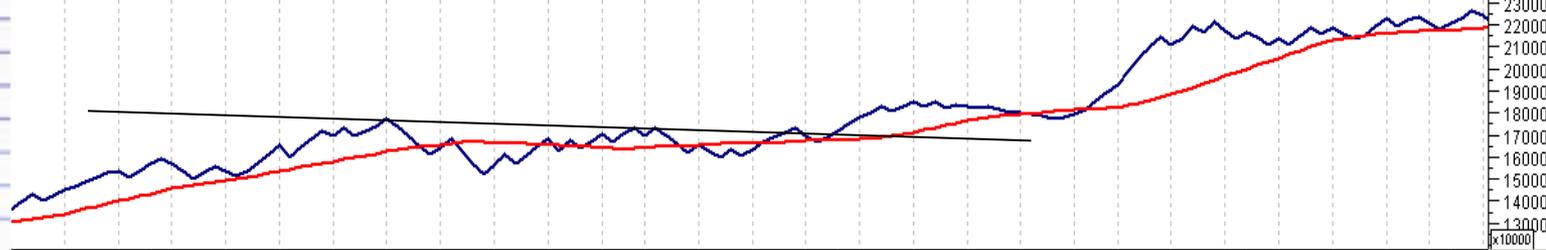
# (Дневник, мертвая зона)



nl Movement ADX (33.0000)



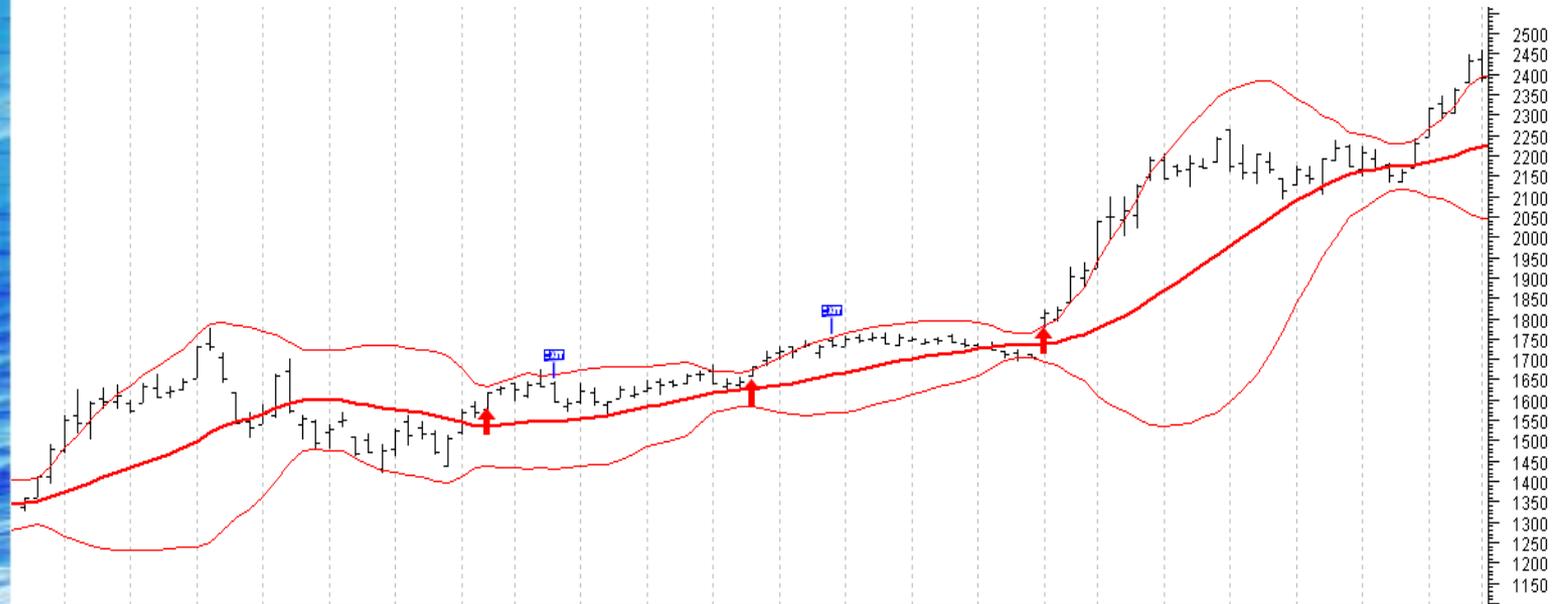
ance Volume (242,963,104.0)



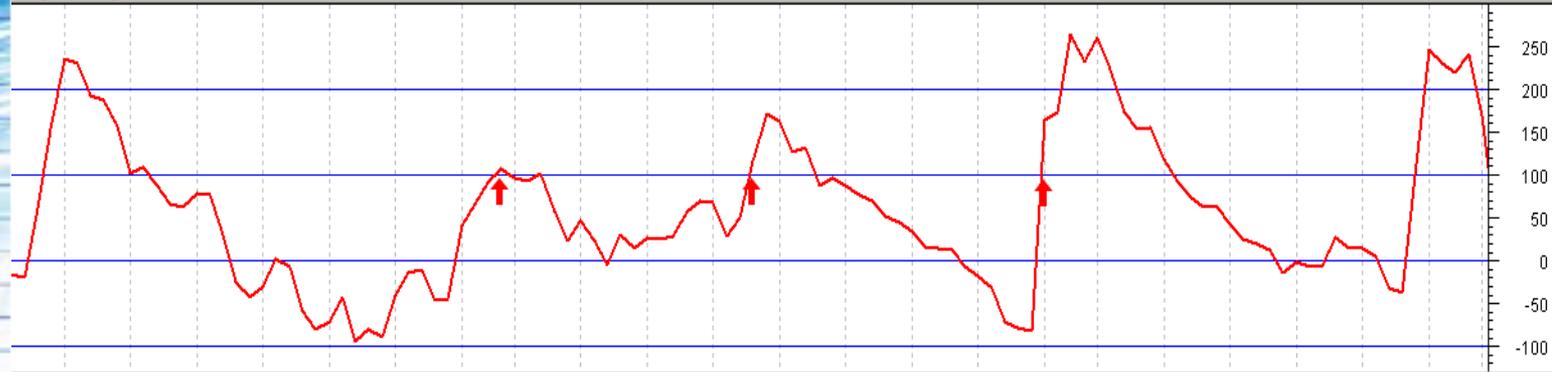
15 22 29 5 12 19 26 3 10 17 24 31 7 14 21 28 5 12 19 26 10 16 23 30 6 13 20 27 1  
September October November December 2006 February Marc



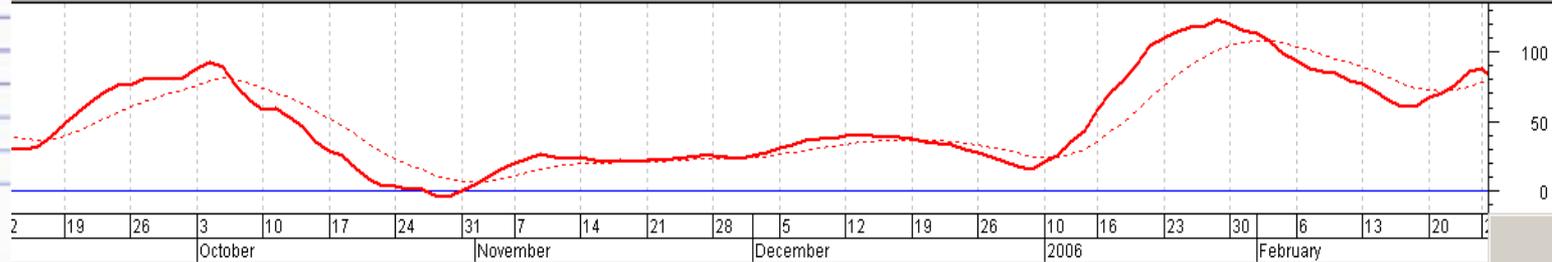
# (Дневник, мертвая зона)



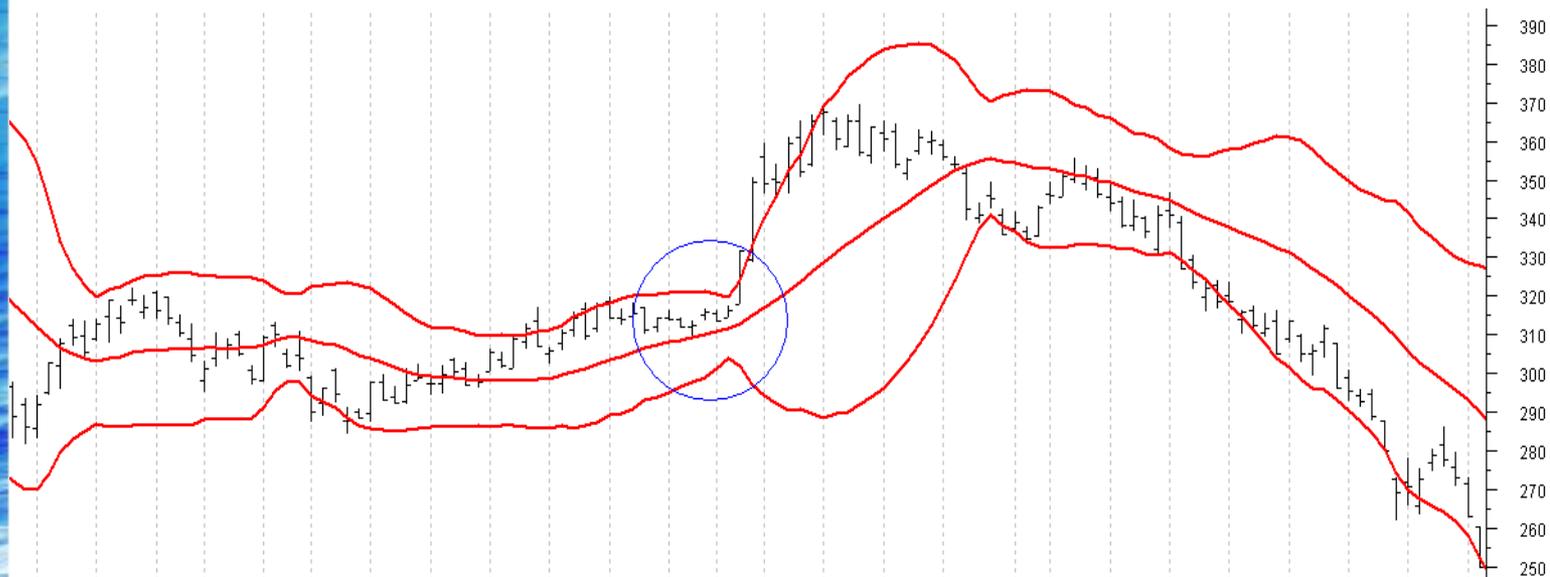
ouis (-42.8641)



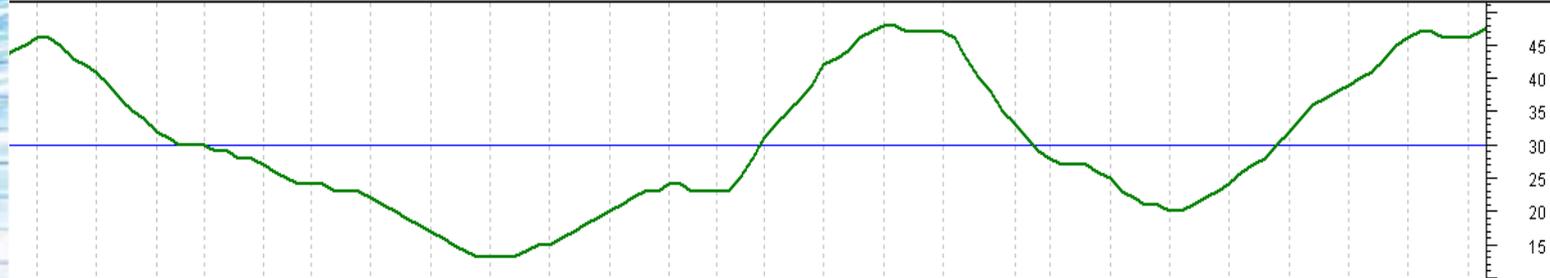
(-59.4469)



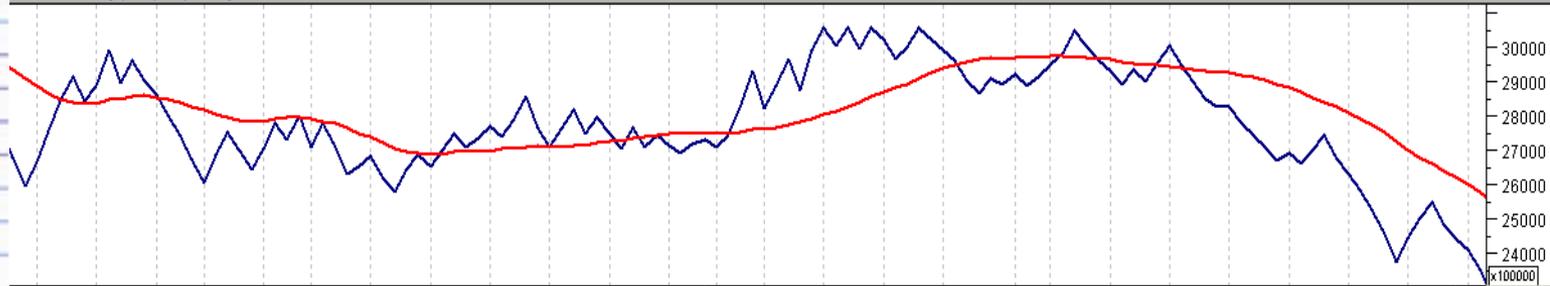
# (Дневник, мертвая зона 5-10 бар)



Volatility Movement ADX (22.0000)



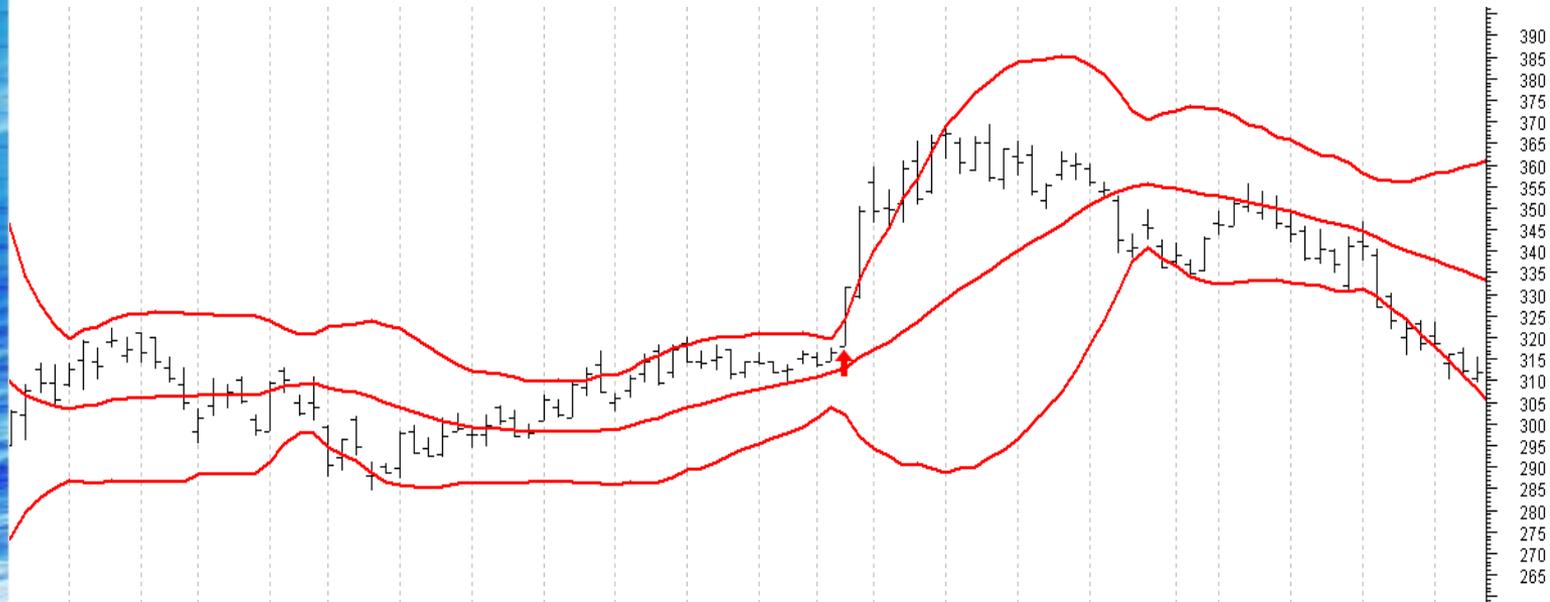
Open Interest Volume (3,157,560,832.0)



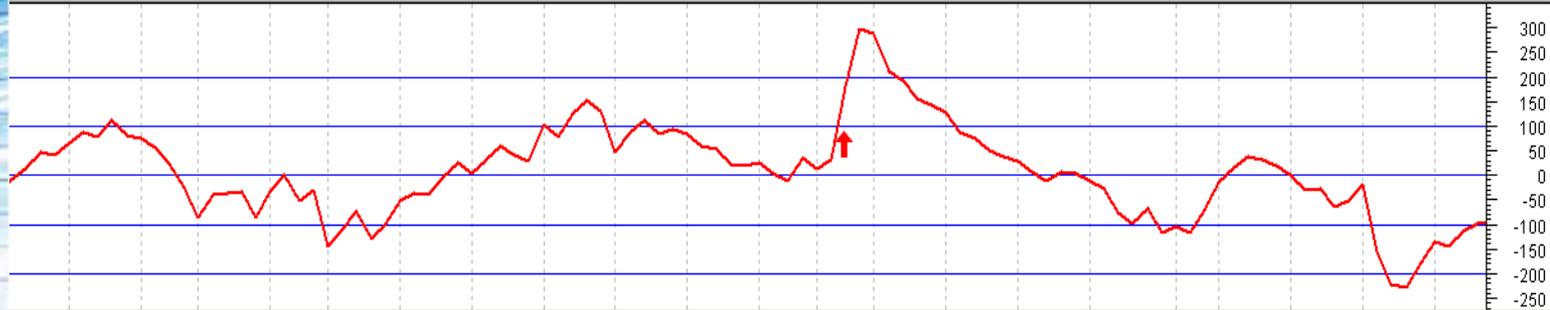
January 11 18 26 March 3 11 17 24 31 April 7 14 21 28 May 5 12 19 26 June 2 9 16 23 30 July 7 14 21 28 August 4



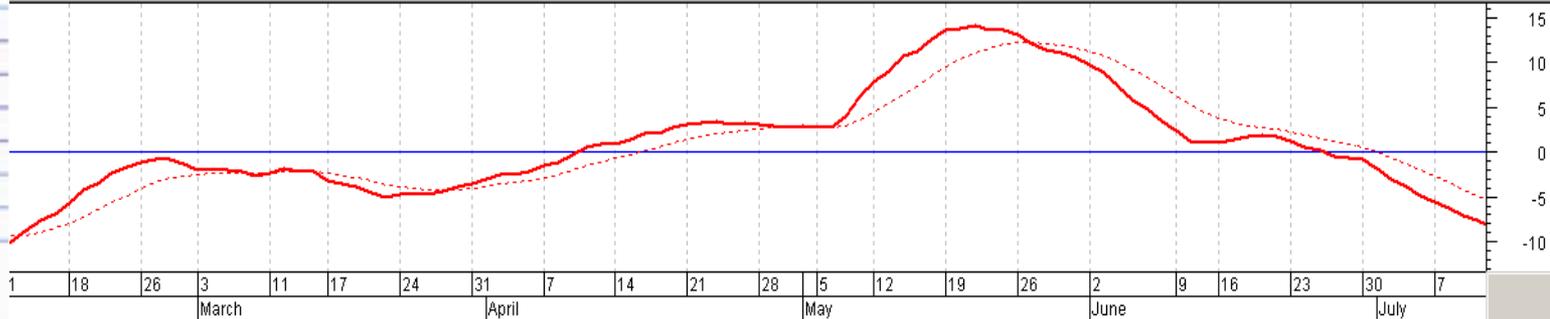
# (Дневник, мертвая зона 5-10 бар)



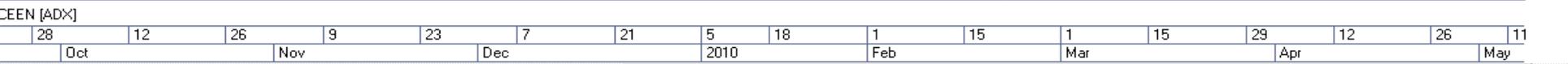
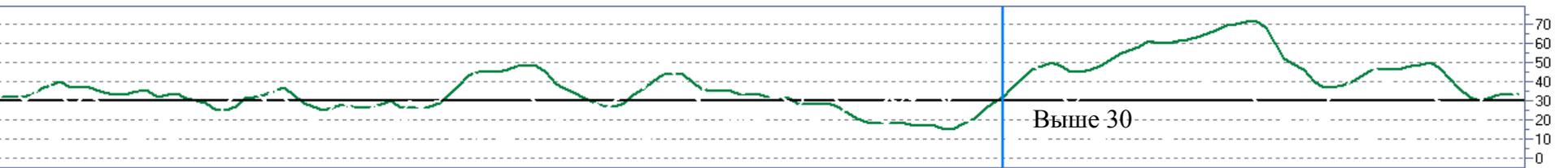
uis (-74.4728)



(-5.62876)



# Центрэнерго дневной чарт



# Характер украинского рынка

- Рынок достаточно техничен и прост
- Движение в трендовой волне без откатов
- Разгон часто плавный с последующим резким всплеском волатильности

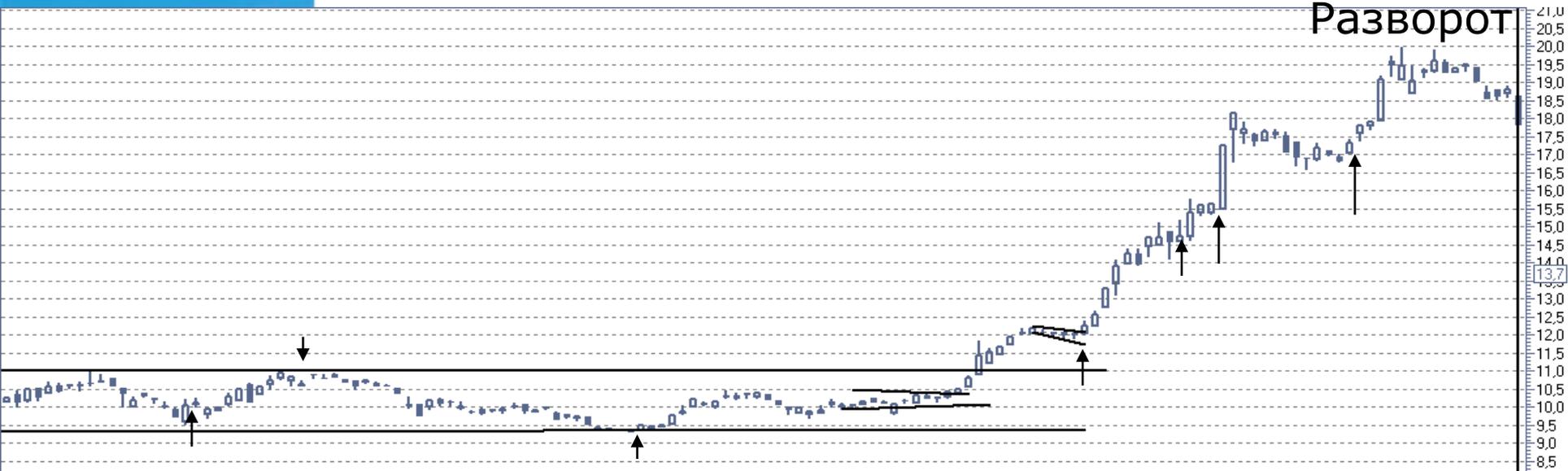
## Стратегии:

- Характер – импульсный (резкий переход к активному тренду)
- Лучше работают управление рисками в активном тренде и пробойные техники
- Игра на боковом рынке осторожная

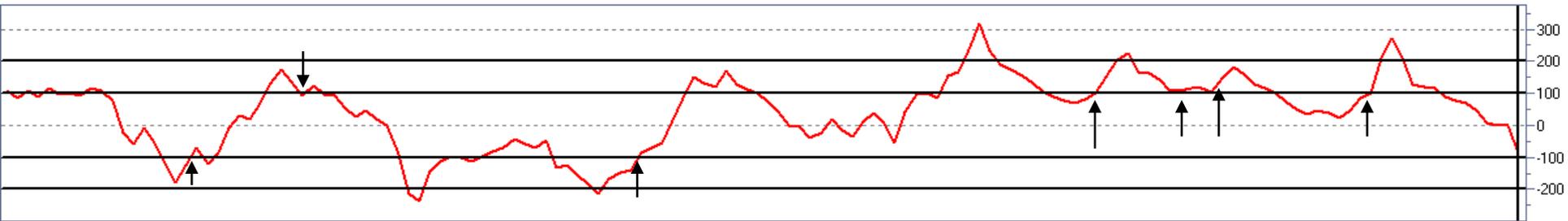


# Центрэнерго дневной чарт

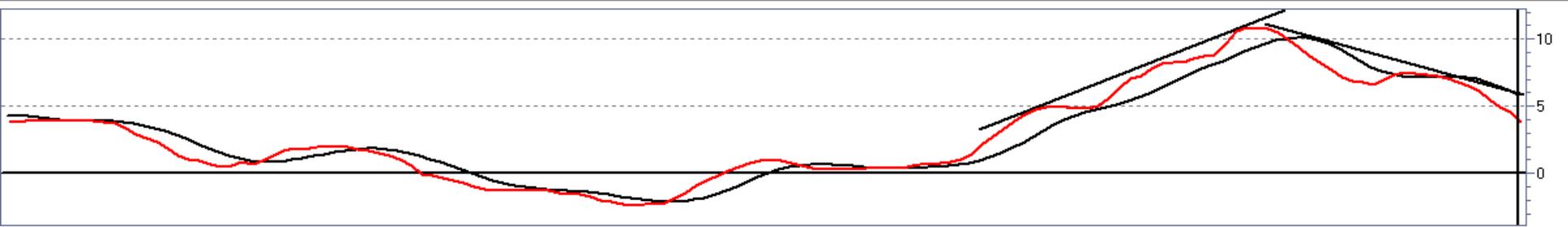
Разворот



CEEN [Цена]



CEEN [CCI]



CEEN [MACD]

12 26 9 23 7 21 5 18 1 15 1 15 29 12 26  
 Nov Dec 2010 Feb Mar Apr May

# СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ

## Контактная информация



**Адрес:** 197110, Санкт-Петербург,  
ул. Петрозаводская, 11

**тел.:** (812) 6-100-100  
(812) 380-30-08

**факс:** (812) 380-30-86

**сайт :** [www.eltrast.ru](http://www.eltrast.ru)

