

10 лет успешного дей-трединга



18 мая 2012 г.
Беритц Андрей

Бизнес-план

Должен затрагивать следующие моменты:

1. Время на обучение:

есть ли у вас время на изучение трейдинга?

2. Непосредственно время на саму торговлю:

выбор рабочего таймфрейма.

3. Размер торгового капитала:

% от него – ваш текущий доход.

4. Выбор стратегии:

должна стыковаться с вашим психотипом.

5. Риск, мани-менеджмент:

выбор оптимальных параметров.

Развития первоклассного исполнения

Общее в процессе развития первоклассного исполнения:

- **Обнаружение ниши.**
- **Практика.**
- **Постоянная обратная связь.**

Неопытный трейдер

Общие минусы:

- **Отсутствие навыков.**
- **Ограничивающие понятия.**
- **Отсутствие самоконтроля.**

Задачи трейдинга

Торговая система – средство оценки поведения рынка.

- выявления его характера, типа и силы.
- системы дают ограниченный набор вариантов поведения рынка.
- системы не рассчитаны на подачу отдельных сигналов.

Другое назначение:

- выявить закономерности в ценовом поведении.
- дать им количественную оценку.
- классифицировать.
- получить статистически надежный результат.

Анализ рынка

Смотрим на цену через призму – **причины и следствия**

Цена – это решения 2 трейдеров о продаже и покупке

Как движется цена:

- движение цены это дисбаланс спроса и предложения.
- это приводит к изменению настроения участников рынка.
- цена зависит от настроения участников рынка.

Рассматриваем движение цены с перспективы других трейдеров

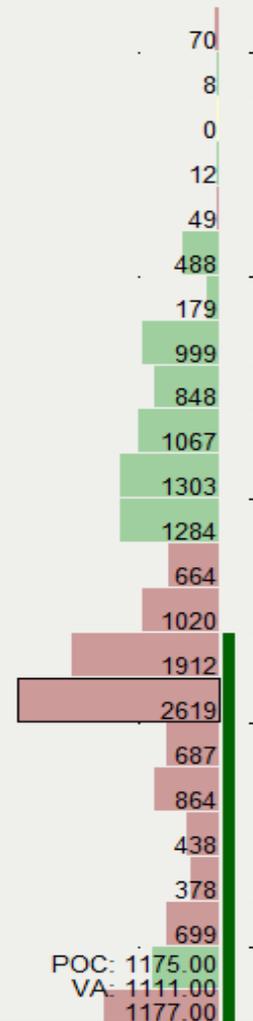
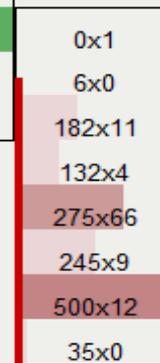
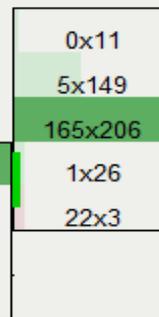
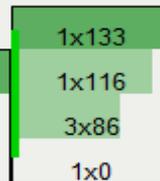
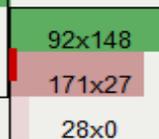
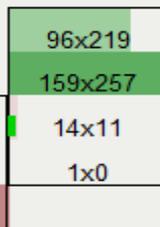
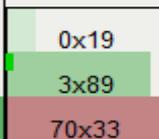
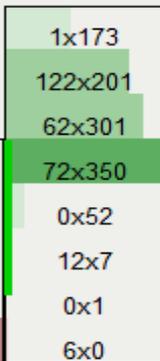
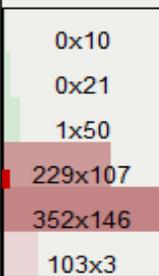
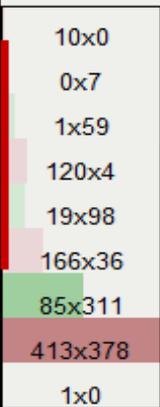
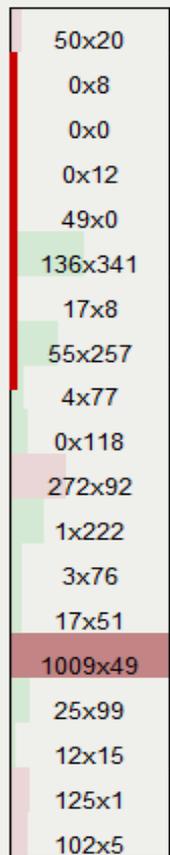
Анализ рынка в моменте

- Кто платит дороже?
- Какова ли сила этой группы?
- Набирает ли это движение темп?
- Можно ли его соизмерить с чем-либо?
- Слабеет ли тенденция?
- На каком этапе, берут прибыль?
- Когда начнётся бегство с рынка, проигравших?
- Если паники не произошло. О чем это говорит?
- Мнение для смены тренда. Люди трудно расстаются со своими понятиями.
- Оцениваем вероятность движения. Риск в сделке.

FootPrint (bid-ask) - программа Xtick

UX.UXM2, 5 min - Фьючерс на индекс УБ-6.12

Tick size: 1.00



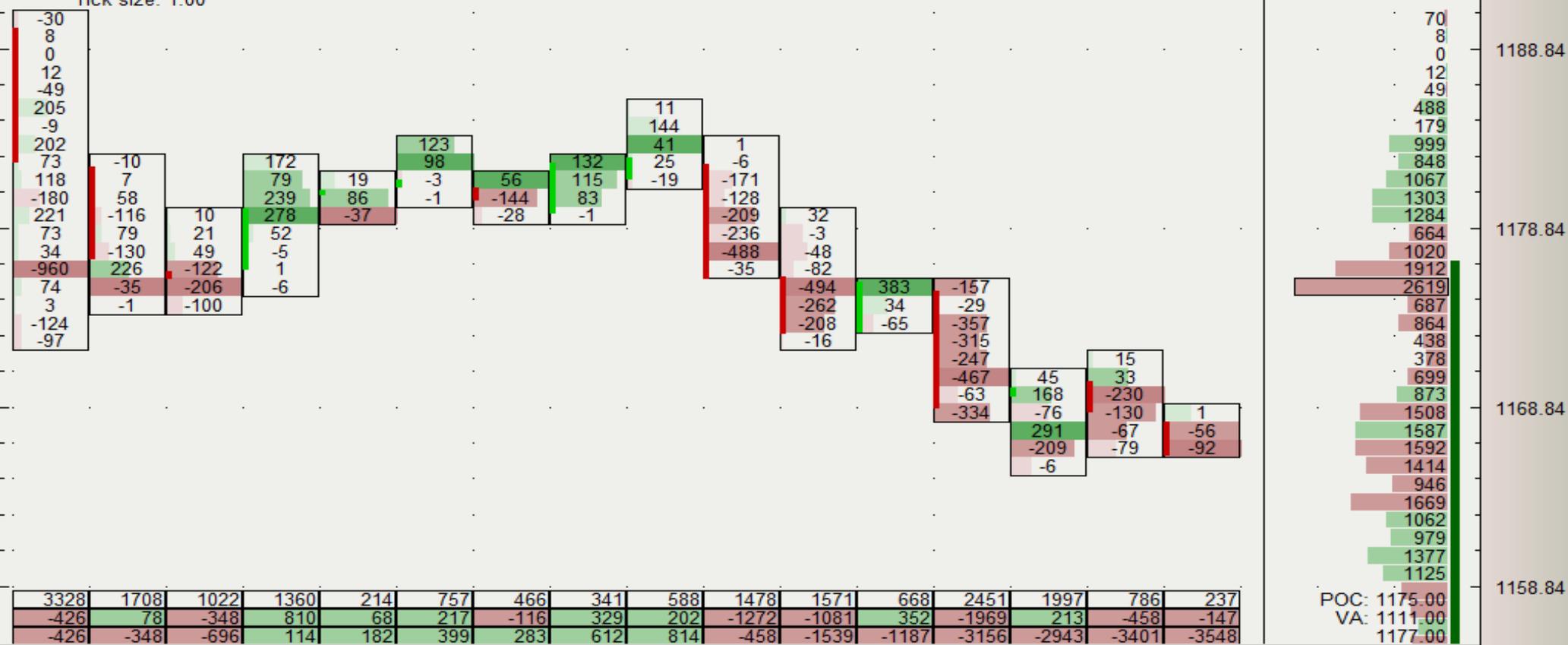
3328	1708	1022	1360	214	757	466	341	588	1478
-426	78	-348	810	68	217	-116	329	202	-1272
-426	-348	-696	114	182	399	283	612	814	-458

POC: 1175.00
VA: 1111.00
1177.00

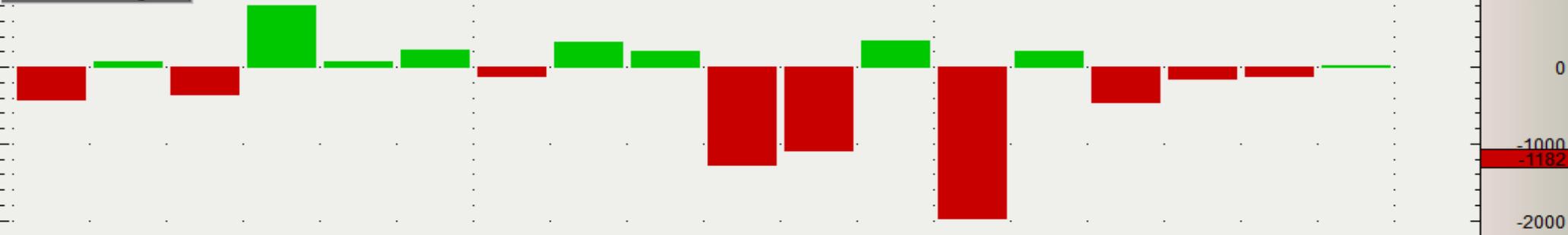
FootPrint (delta) с индикатором Pit Volume Divergence

UX.UXM2, 5 min - Фьючерс на индекс УБ-6.12

Tick size: 1.00



Pit Volume Divergence



UX 5 min с индикатором Pit Volume Divergence

UX.UXM2, 5 min - Фьючерс на индекс УБ-6.12



Лента – таблица всех сделок

В первом случае объем без фильтра, во втором с фильтром 10

TS Time & Sales			
UX.UXM2 - Фьючерс на индекс ф €			
Last: 967.40 / -7.07 %		Vol: 21752	
Bid			Offer
966.70		967.40	
1		3	
3137		5265	
Время	Посл...	Объем	
12:26:34	967.40	1	
12:26:33	967.30	1	
12:26:32	967.00	2	
12:26:32	967.00	2	
12:26:32	967.00	1	
12:26:32	967.00	2	
12:26:31	967.00	27	
12:26:31	966.90	10	
12:26:31	965.00	50	
12:26:31	965.00	3	
12:26:31	965.00	2	
12:26:31	965.00	8	
12:26:31	965.00	1	
12:26:30	965.00	51	
12:26:30	964.90	15	
12:26:30	964.90	4	
12:26:29	964.90	1	
12:26:29	964.90	1	
12:26:23	964.90	1	
12:26:22	964.80	2	
12:26:22	964.90	1	
12:26:22	964.90	1	
12:26:21	964.90	1	
12:26:20	964.90	2	
12:26:19	964.90	12	
12:26:19	964.60	3	
12:26:15	964.60	1	
12:26:13	964.20	5	
12:26:13	964.10	2	

TS Time & Sales			
UX.UXM2 - Фьючерс на индекс ф €			
Last: 967.40 / -7.07 %		Vol: 21752 [10]	
Bid			Offer
966.70		967.40	
1		3	
3137		5265	
Время	Посл...	Объем	
12:26:31	967.00	27	
12:26:31	966.90	10	
12:26:31	965.00	50	
12:26:30	965.00	51	
12:26:30	964.90	15	
12:26:19	964.90	12	
12:26:13	963.60	18	
12:26:05	963.00	20	
12:25:58	964.00	186	
12:25:58	964.20	17	
12:25:55	964.20	10	
12:25:50	964.60	50	
12:25:49	965.00	39	
12:25:49	965.00	11	
12:25:47	965.00	10	
12:25:45	965.00	70	
12:25:45	964.90	10	
12:25:45	964.80	100	
12:25:45	964.80	50	
12:25:45	964.60	20	
12:25:45	964.60	20	
12:25:45	964.60	28	
12:25:45	963.30	15	
12:25:45	963.00	200	
12:25:45	963.00	19	
12:25:45	962.90	20	
12:25:45	962.00	100	
12:25:45	962.00	20	
12:25:45	961.90	450	

UX 1 min - Pit Volume Divergence, Volume, Лента.



TS Time & Sales

UX.UXM2 - Фьючерс на индекс

Last: 986.10 / -5.27 %
Vol: 23735 [10]

Big	886.30	986.90	Offer
10		8	
5314		4283	

Время	Посл...	Объем
12:29:15	986.10	42
12:29:13	985.00	50
12:29:13	985.00	10
12:29:08	984.00	17
12:29:08	983.80	30
12:29:08	983.50	25
12:29:08	983.50	28
12:29:05	983.00	48
12:29:04	982.20	48
12:28:58	982.00	23
12:28:55	982.00	18
12:28:54	981.90	38
12:28:51	981.90	10
12:28:45	980.00	50
12:28:45	980.00	10
12:28:45	980.00	19
12:28:40	980.00	12
12:28:39	980.00	24
12:28:39	980.00	53
12:28:39	980.00	25
12:28:39	979.50	44
12:28:39	979.00	50
12:28:34	979.00	194
12:28:33	977.00	20
12:28:33	977.00	24

Привод Quot pro

Цена, по которой выставлена условная заявка (стоп-заявка) выделяется жирным шрифтом выбранного Вами цвета (в данном случае синий)

Строка, в которой присутствует Ваша заявка выделяется жирным шрифтом

Большие заявки можно подсвечивать выбранным Вами цветом, также возможно увеличение его интенсивности с увеличением объема заявки

1 959.59	4
1 957.99	10
1 956.96	3
1 955.00	50
1 952.01	
1 952.00	250
1 951.00	100
1 950.50	100
1 950.00	21
1 949.95	5
1 949.94	4
1 948.50	10
1 948.00	60
1 947.99	1
1 947.00	40
1 944.00	50
1 943.58	5
1 943.50	10
1 943.01	10
1 943.00	260
1 942.02	10
1 942.01	30
1 942.00	10
1 941.25	10
1 941.02	3
1 941.01	5
1 941.00	100
1 940.50	100
1 940.30	35

Средняя цена входа в позицию. Красный цвет - шорт, зеленый - лонг

Quot pro 5

15:47:26 [266] Заявка поставлена

P **1950.00** VOL 1 Cash

V 1 ↓ SEC UXZO S T s

Отображение цены, объема и операции отправляемой заявки

Объем по умолчанию для текущего инструмента

Выбор рабочего инструмента

Вызов окна настроек

S (T) - выставить автоматически стоп-лосс (тейк-профит) при входе в позицию

Опыт автоматизации

- Stop Loss, Take Profit, Trailing stop
- выставится в спреде.
- покупка и продажа по рынку с ограничением.
- Front run.
- горячие клавиши и макросы
- авто выход для остатка позиции.
- фильтр для кол-ва лотов.
- алерты.
- автоматизация статистики
- риск-менеджер

Equity

Refresh	Profit	Comis	%	Count	+Count	-Count	Avg+	Avg-	+Profit	-Profit	Long	Short	Time	+AvgT	-AvgT	AvgVol
	20 922	18 163,2	52 / 47	913	475	438	142,04	-106,27	67 467	-46 543	456	457	510:21:15	0:48:56	0:16:52	49,73
Filters	Account	Ticker	Date	OpenT	CloseT	Time	Vol	Dir	Margin	Profit	LotProfit	Comis	Open	Close	ID	rade
	336	Gekko	UXZ1	28.10.2011	12:41:27	12:44:33	0:03:07	35	long	-46	-60	-1,74	14	1 528	1 527	336
Summary	337	Gekko	UXZ1	28.10.2011	12:44:33	12:52:51	0:08:19	65	short	29	3	0,04	26	1 526	1 525	337
	338	Gekko	UXZ1	28.10.2011	12:52:51	12:54:06	0:01:16	31	long	102	89	2,89	12,4	1 528	1 531	338
Diary	339	Gekko	UXZ1	28.10.2011	12:54:06	13:34:58	0:40:53	333	short	1 054	921	2,77	133,2	1 521	1 518	339
	340	Gekko	UXZ1	28.10.2011	13:34:58	13:35:41	0:00:43	21	long	57	48	2,3	8,4	1 510	1 513	340
Trades	341	Gekko	UXZ1	28.10.2011	13:35:41	14:09:33	0:33:53	61	short	-381	-405	-6,66	24,4	1 511	1 518	341
	342	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:09:33	14:10:12	0:00:40	42	long	74	57	1,35	16,8	1 526	1 528	342
Positions	343	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:10:12	14:12:04	0:01:52	19	short	-12	-19	-1,06	7,6	1 526	1 527	343
	344	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:12:04	14:13:48	0:01:45	42	long	-54	-71	-1,71	16,8	1 527	1 526	344
Deals	345	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:13:48	14:36:54	0:23:07	107	short	414	371	3,47	42,8	1 519	1 515	345
	346	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:36:54	14:46:55	0:10:02	36	long	-74	-89	-2,49	14,4	1 518	1 516	346
Orders	347	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:46:55	14:54:22	0:07:27	19	short	36	29	1,51	7,6	1 515	1 513	347
	348	Gekko	UXZ1	28.10.2011	14:54:22	15:06:09	0:11:47	42	long	231	214	5,1	16,8	1 513	1 519	348
	349	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:06:09	15:24:11	0:18:02	19	short	10	2	0,1	7,6	1 519	1 518	349
	350	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:24:11	15:30:06	0:05:55	42	long	-33	-50	-1,2	16,8	1 518	1 517	350
	351	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:30:06	15:31:10	0:01:05	19	short	40	32	1,7	7,6	1 517	1 515	351
	352	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:31:10	15:32:15	0:01:06	72	long	-87	-116	-1,62	28,8	1 516	1 515	352
	353	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:32:15	15:35:05	0:02:51	19	short	21	13	0,69	7,6	1 514	1 513	353
	354	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:35:05	15:41:24	0:06:19	42	long	34	18	0,42	16,8	1 513	1 514	354
	355	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:41:24	15:50:30	0:09:06	56	short	55	32	0,58	22,4	1 513	1 512	355
	356	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:50:30	15:56:02	0:05:33	42	long	68	51	1,21	16,8	1 514	1 515	356
Play	357	Gekko	UXZ1	28.10.2011	15:56:02	16:11:07	0:15:05	58	short	134	110	1,9	23,2	1 510	1 507	357
	358	Gekko	UXZ1	28.10.2011	16:11:07	16:15:17	0:04:11	11	long	-32	-36	-3,39	4,4	1 509	1 506	358
References	359	Gekko	UXZ1	28.10.2011	16:15:17	16:17:36	0:02:19	19	short	-67	-74	-3,97	7,6	1 506	1 510	359

Equity

Filter options <input type="checkbox"/> Lock		Date	Margin	Profit	Comis	%	Avg+	Avg-	Trades	Deals	High	Low	
Refresh	General <input type="checkbox"/> Day <input type="checkbox"/> Eve <input type="checkbox"/> Today		20.10.2011	-268	-604	336	31 / 68	65	-71	22	148	109	-772
Filters	<input type="checkbox"/> Begin: 16.05.2012 0:00:00		21.10.2011	-268	-606	338	42 / 57	38	-60	33	158	0	-666
Summary	<input type="checkbox"/> End: 16.05.2012 23:59:59		24.10.2011	761	-56	818	46 / 53	67	-59	67	369	559	-172
Diary	<input type="checkbox"/> Between: 0:00:00 23:59:59		25.10.2011	2 600	1 678	922	51 / 48	94	-46	64	360	1 864	0
Trades	Direction: Short/Long		26.10.2011	306	-383	690	62 / 37	60	-121	54	344	0	-1 358
Positions	Accounts <input type="checkbox"/> All		27.10.2011	150	-669	820	51 / 48	84	-111	64	325	0	-1 065
Deals	<input checked="" type="checkbox"/> Gekko		28.10.2011	4 140	3 169	970	60 / 40	147	-88	60	453	3 169	0
Orders	Symbols <input type="checkbox"/> All		31.10.2011	981	501	480	48 / 51	134	-89	27	177	1 249	0
	<input checked="" type="checkbox"/> UXZ1		01.11.2011	5 031	3 701	1 330	61 / 38	151	-73	57	483	3 731	0
			02.11.2011	3 611	2 020	1 591	43 / 56	199	-98	64	595	2 497	-413
			03.11.2011	5 157	3 432	1 725	56 / 43	167	-124	85	562	3 432	0
			04.11.2011	546	-651	1 198	60 / 39	136	-246	43	395	1 025	-1 882
			07.11.2011	3 978	2 683	1 295	55 / 44	156	-99	63	478	2 683	-1 168
			08.11.2011	3 100	1 614	1 485	47 / 52	191	-124	63	573	1 614	0
			09.11.2011	5 552	3 187	2 365	48 / 51	229	-140	80	811	6 177	0
			10.11.2011	3 711	1 911	1 800	49 / 50	204	-142	67	587	3 135	0



БЛАГОДАРЮ ЗА ВНИМАНИЕ

Контакты:

mumitroll82@rambler.ru

www.pskovstock.com www.tradetrade.ru

facebook.com/beritzz

vk.com/beritzz