

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

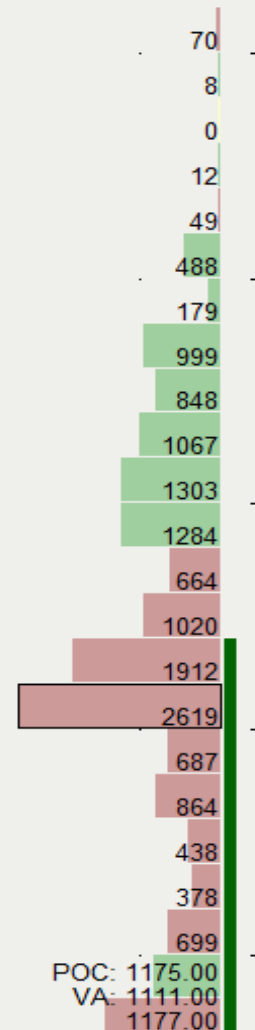
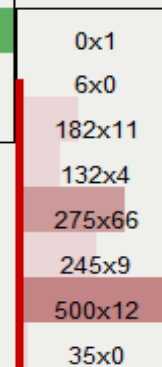
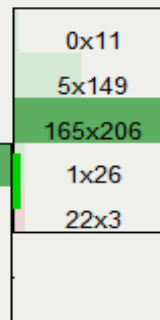
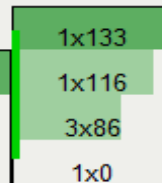
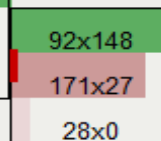
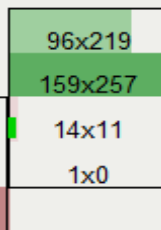
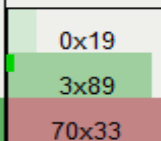
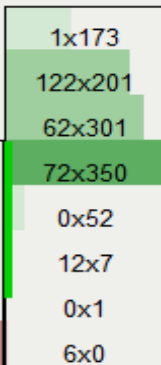
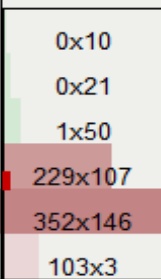
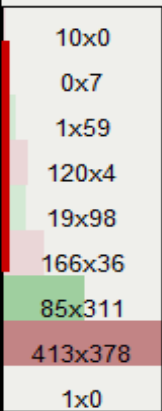
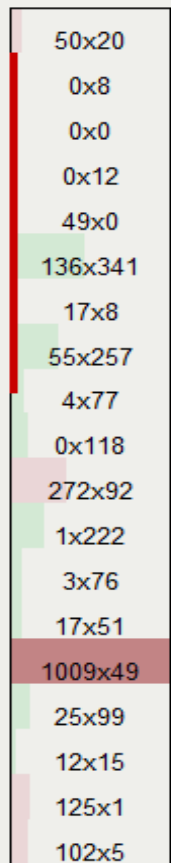
Анализ рынка в моменте

- 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

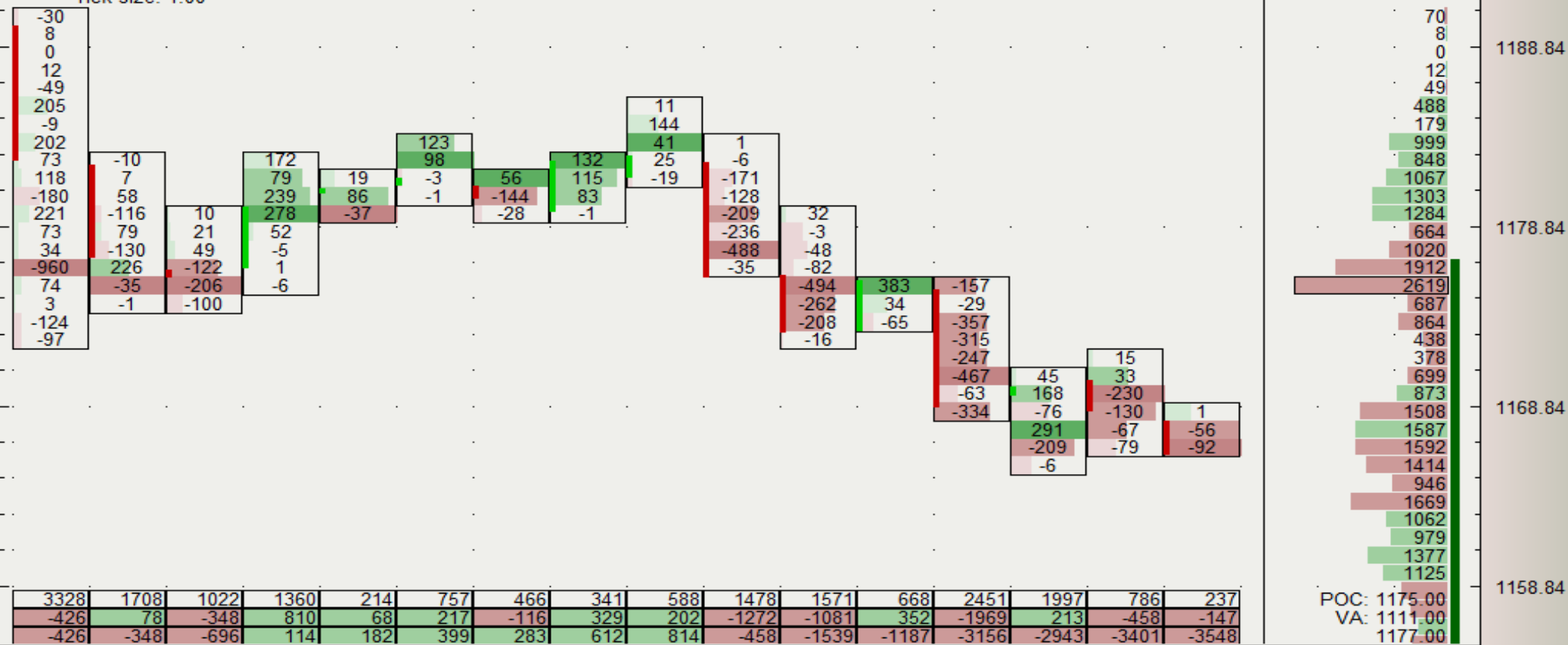


| | | | | | | | | | |
|------|------|------|------|-----|-----|------|-----|-----|-------|
| 3328 | 1708 | 1022 | 1360 | 214 | 757 | 466 | 341 | 588 | 1478 |
| -426 | 78 | -348 | 810 | 68 | 217 | -116 | 329 | 202 | -1272 |
| -426 | -348 | -696 | 114 | 182 | 399 | 283 | 612 | 814 | -458 |

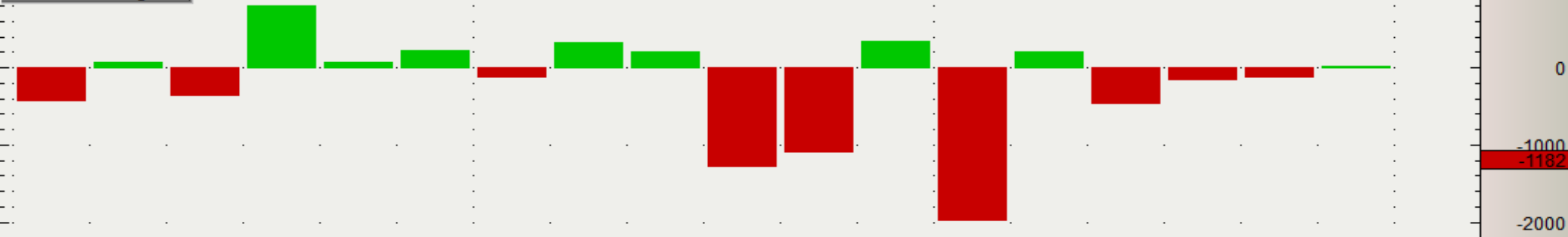
FootPrint (delta) с индикатором Pit Volume Divergence

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

Tick size: 1.00



Pit Volume Divergence



Time axis: :30, 11:35, 11:40, 11:45, 11:50, 11:55, 12:00, 12:05, 12:10, 12:15, 12:20, 12:25, 12:30, 12:35, 12:40, 12:45, 12:50, 12:55, 13:00

UX 5 min с индикатором Pit Volume Divergence



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 | 896.30 10 5314 | 8986.90 8 4283 | Offer |
|----------|----------------------|----------------------|-------|
| 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 |
| References | 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 |
| | 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