

LEPRECON

REVIEW



Выпускается при поддержке
Интернет-ресурса



Май 2010
(№6)

nordFX

ГЕНЕРАЛЬНЫЙ СПОНСОР ВЫПУСКА

Обзоры торговых систем

«SPIKE EA»

«USDBOT»

«MAGIC FOREX BOT»

«FXRANGEBREAKER»

Уроки программирования

ШКОЛА MQL4 (Уроки 21-23)

КВАЗИАРБИТРАЖ В MT4 (часть 4)

Торговые хитрости

ВВЕДЕНИЕ В ОПЦИОНЫ

Практический трейдинг

ФРАКТАЛЬНО-ПИВОТНАЯ

ТОРГОВАЯ СИСТЕМА

Интервью

МАКСИМ АНИСИМОВ (Fibo Group)

Психология трейдинга

ВЛАСТЕЛИН ЭМОЦИЙ

АНАЛИТИКА, МОНИТОРИНГ СОВЕТНИКОВ,

РЕЙТИНГИ, НАШ ЮБИЛЕЙ

КТО ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?



Currenex — фундамент вашего успеха

NordFX открывает прямой доступ к электронной системе торгов **Currenex**, объединяющей более 70 крупнейших банков. Получи неограниченный доступ к межбанковской ликвидности и лучшие цены.

NordFX предлагает **лучшие условия**, доступные на Форекс:

- прямые банковские котировки;
- динамический спред от 0 пунктов;
- 26 валютных пар;
- минимальный лот 0.1 и плечо 1:100;
- мгновенное исполнение и любые стратегии;
- минимальные комиссии.

Для торговли на Currenex доступны следующие **STP платформы**:

- Currenex FX Trading (Classic);
- Viking Trader;
- FIX API протокол.



СОДЕРЖАНИЕ

ОТ РЕДАКТОРА	4
НОВОСТИ	5
АНАЛИТИКА	9
ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ	
«SPIKE EA»	16
«USDBOT»	22
«Magic Forex Bot»	29
«FxRangeBreaker»	35
МОНИТОРИНГ СОВЕТНИКОВ	
«FXBrokerBuster»	42
УРОКИ ПРОГРАММИРОВАНИЯ	
Школа MQL4 (Уроки 21-23)	45
Квазиарбитраж в МТ4 (часть 4)	56
ТОРГОВЫЕ ХИТРОСТИ	
Введение в опционы	62
ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ	
Фрактально-Пивотная торговая система	68
ИНТЕРВЬЮ	
Максим Анисимов (Fibo Group)	73
ПСИХОЛОГИЯ ТРЕЙДИНГА	
Властелин эмоций	76
ТОЧКА ЗРЕНИЯ	
TFL – торговая система на основе ценовых каналов ...	79
РЕЙТИНГ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ	87
РЕЙТИНГ СИГНАЛЬНЫХ СЕРВИСОВ	91
НАШ ЮБИЛЕЙ	93
КТО ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?	94

© 2010 Все права на данные материалы принадлежат LepreconTrading.com
Полная или частичная перепечатка запрещены!

ОТ РЕДАКТОРА



Приветствую Вас, дорогие читатели. Вы читаете уже шестой номер журнала «Leprecon Review», а, значит, мы делаем правильное и интересное дело и добрались до небольшого юбилея сроком в полгода. Спасибо Вам за то, что Вы не остаетесь равнодушными - интересуетесь, пишете письма, комментарии и просьбы. В этом номере мы хотим предложить нововведение, которое упростит Вам написание писем. В конце каждой статьи теперь можно найти специальную кнопку «Написать письмо», нажав на которую, Вы сможете без лишних затруднений написать письмо автору статьи, а тема письма подставится в поле «Тема письма» Вашего почтового редактора автоматически. Пишите нам еще больше, с удовольствием ждем Ваших откликов!

Хочу также отметить еще одно приятное событие – число клиентов компании «Leprecon Trading» превысило 6000 и продолжает свой рост. В этом номере журнала мы познакомим Вас с клиентом, ставшим юбилейным 6000-ым. Также у нас Вы найдете обзоры торговых систем, тесты и мониторинги советников. В рубрике «Практический трейдинг» Вас ждет фрактально-pivotная торговая система с видеодополнением от автора. А к статье «Квазиарбитраж в MT4 (часть 4)» приложен рабочий советник, с помощью которого можно протестировать описанную стратегию на демо-счете в реальном времени. Постоянная рубрика «Интервью» в этот раз познакомит Вас с Максимом Николаевичем Анисимовым, членом Совета директоров МФХ «FIBO Group».

А для наших новых читателей мы подготовили специальную статью «Кто такой Лепрекон», которая расскажет о компании «Leprecon Trading», ее услугах, ресурсах и символике.

Оставайтесь с нами!

Главный редактор Алекс Миньков

Новости Лепрекона



Нами добавлены к сервису две новые компании:



«**MIG BANK**» предоставляет специализированные услуги участникам рынка торговли иностранной валютой (Forex) в более чем 120 странах на более чем 20 языках. Является первым швейцарским банком, который работает исключительно на рынке Forex.

Внимание! В договоре на открытие торгового счёта Вам необходимо указать наш партнёрский номер – 70015. Без указания номера присоединение торгового счёта к нашей системе будет невозможным!



«**Peregrine Financial Group, Inc.**» Американская корпорация Перегрин Файненшиал Груп (PFG) является членом Национальной Фьючерсной Ассоциации (NFA) (Регистрационный номер 232217) и зарегистрирована в Комиссии по Торговле Товарными Фьючерсами (CFTC) как не-клиринговый Фьючерсный Комиссионный Коммерсант (FCM)* с 1992 года.

Не забывайте, что после открытия счетов в указанных ДЦ, необходимо зафиксировать данные торгового счёта в Личном Кабинете клиента «**LepreconTrading**» - пункт меню «Счета».



Нами достигнуто соглашение с компанией «**CMS Forex**» о повышении компенсации для нашего сервиса. Сейчас компенсация составляет 7 долларов за торгуемый лот, но уже начиная с 1 мая 2010 г. выплаты будут увеличены до 10 долларов за торгуемый лот*. В дальнейшем Лепрекон, совместно с «**CMS Forex**», планирует сделать выплаты от этой компании ещё больше и довести их по некоторым парам до 15 долларов за торгуемый лот.

* Все цифры указаны без комиссии Лепрекона.



Нами достигнута договорённость с компанией «**Exness**» по увеличению партнёрских выплат. С 1 мая 2010 г. выплаты по этой компании будут увеличены до 22 процентов. Некоторые сделки за прошлый месяц тоже попадают под увеличение выплат уже в этом месяце. С чем всех и поздравляем!

В связи с очень большим количеством заходов одновременно на сайты Лепрекона и Лаборатории, был произведен перенос сайтов на два новых отдельных сервера.

Нами проведена синхронизация подключенных к базе данных торговых счетов. В процессе синхронизации нами было найдено более 100 счетов, не подключенных к базе. Это значит, что эти счета не были добавлены клиентами Лепрекона на одобрение в своих ЛК. Мы напоминаем, что для получения от нас выплат, Ваш счёт должен быть добавлен у Вас в ЛК и иметь статус одобренного.

Список счетов, открытых через систему LepreconTrading

Внимание! При подключении счёта, учитывайте следующие факторы:

- На одобрение счёта может уйти от 2 до 10 рабочих дней, в зависимости от компании-брокера и подключаемого счёта.
- Счета, открытые под другими агентскими счетами, не могут быть добавлены в систему LepreconTrading.
- Обязательно читайте внимательно, что Вам пишет окошко с предупреждением при выборе компании-брокера. Некоторые компании не позволяют делать перенос счетов открытых не через нас в нашу систему.
- Сервис LepreconTrading не несёт ответственности за забывчивость клиента, если Вы забыли добавить свой счёт после его открытия, то наша система не сможет найти Ваш счёт и следовательно сделать на него выплаты.
- Сервис LepreconTrading оставляет за собой право удалять заявки клиентов, если в течении десяти рабочих дней от клиентов не было получено ответа на запрос службы поддержки.

Если у Вас возникли какие-либо вопросы, обязательно свяжитесь с нашей [службой поддержки](#).

Брокер	Номер счёта	Статус
NordFX	9949	Одобен

[Добавить](#)

Статистика

Количество регистраций:

6236

Количество клиентов компании «LepreconTrading» превысило 6200.

Всего клиентам выплачено:

391373.2

USD

Сумма выплат клиентам компании «LepreconTrading» за все время ее существования превысила 390000\$ и стремительно приближается к очередной круглой отметке!

Список брокеров, доступных для регистрации в компании «LepreconTrading» по состоянию на 10 мая 2010 г. выглядит следующим образом:

Брокеры

Если Вы торгуете в компании, которой нет в нашем списке, то свяжитесь с нами и мы постараемся добавить такую компанию в самые короткие сроки.



Компания «LepreconTrading» совместно с «ForexZone Ltd» представляет новый конкурс:



10 мая 2010 г. стартовал наш мини-чемпионат по торговле «Монстр торговли».

Список участников:

№	Участник	Счет	Стратегия
1	Давыдов Валерий	78212	Сеточная торговля по паре EUR/USD
2	Сунгатуллин Раис	79473	Внутридневная, среднесрочно-сеточная и трендовая торговля по парам EUR/USD, GBP/USD
3	Москаленко Евгений	79891	Торговля по индикатору Stochastic по паре GBP/USD
4	Кунин Тимур	83838	Система srsTrend
5	Юхим Роман	80649	Трендовая и скальпинговая стратегии по парам EUR/USD, GBR/USD, EUR/JPY, GBR/JPY
6	Садриев Ренат	80764	Торговля по каналам по парам EUR/USD, GBP/USD, USD/JPY с применением усреднения, ночной скальпинг по паре USD/CAD
7	Хаят Олег	85545	Скальпинг по парам EUR/USD, GBP/USD, USD/CAD, USD/CHF, AUD/USD
8	Шаулко Роман	83400	Торговля советником. Советник использует индикаторы MA и SAR. Работает на развороте. Усреднение. Защита от просадок. К конкретному инструменту не привязан. Держит баланс между инструментами по просадке. Возможна работа на 10-15 парах одновременно (зависит от условий ДЦ). Для конкурса: повышены риски, защиты отключены, пятница рабочая. Начальный ордер 0.1
9	Колосов Юрий	81982	Трендовый советник по паре EUR/USD

10	Морозов Алексей	85638	Пробойная стратегия. Пары EUR/USD, GBP/USD, AUD/USD, USD/CAD, USD/CHF, EUR/JPY
11	Баштынский Сергей	83528	Советник по системе Мартингейл на паре GBP/AUD
12	Смирнов Сергей	83809	Среднесрочная торговля и скальпинг. Пары EUR/USD, EUR/JPY, GBP/USD, EUR/GBP
13	Жумабаев Ербол	83960	Трендовая стратегия
14	Фокин Андрей	83976	Скальпинг по паре EUR/USD
15	Закаблук Владимир	83988	Торговля в канале, скальпинг по парам EUR/USD, USD/JPY, GBP/USD
16	Котлов Анатолий	84079	Сеточная торговля с Мартингейлом
17	Помыткин Александр	84056	Скальпинг по парам EUR/USD, GBP/USD, EUR/GBP и другим
18	Ксендзов Александр	84226	Мартингейл с расчетом дистанции между ордерами в зависимости от ситуации на рынке. Расчет для любой валютной пары в автоматическом режиме в зависимости от наличия исторических данных хотя бы за 1 ближайший месяц
19	Лысенко Виктор	84594	Канальная торговля с элементами скальпирования и использования свечного анализа по валютным парам со спредом меньше 10 пипс
20	Смирнов Михаил	85270	Торговля отложенными ордерами по EUR/USD
21	Roscovan Oleg	85341	Скальпинг по парам EUR/USD, GBP/USD
22	Bogrunov Ivan	85413	Скальпинг по паре EUR/USD
23	Нечаев Илья	85508	Скальпинг по паре EUR/USD

Следить за ходом Чемпионата можно на сайте нашей Лаборатории <http://ealab.ru>

Желаем всем участникам удачи, и пусть победит сильнейший!

Уважаемые авторы!

Наш раздел предлагает уникальную возможность продемонстрировать Вам работу Ваших систем на наших реальных счетах. Мы берём на себя всю заботу о сборе статистики и размещении её на нашем сайте. Для тестов будет предложен счёт в выбранной Вами компании, мы пополним его реальными средствами и подключим к нашему разделу. Мы являемся независимой компанией и можем гарантировать точность и честность предоставляемой информации.

Для установки Вашего счёта на мониторинг в нашей лаборатории Вам не потребуется высылать нам Ваш советник или МТС, мы можем подключить Вас дистанционно, что облегчит Вам работу и позволит более продуктивно торговать на тесте. Кроме того, если Ваша система будет интересна посетителям Лепреконе, мы можем предложить Вам подключить её как сигнальный сервис. Отдельно для Вас будет создан поддомен, который будет вести на Ваш раздел на Лепреконе, что позволит более точно показывать статистику потенциальным клиентам. Такой подход позволит сохранить Вашу систему от нелегального распространения через интернет и даст Вам постоянный и гарантированный доход от Ваших сигналов.

Работать с нами легко и надёжно! Подключение занимает около 24 часов. Предоставляемые счета не имеют изменённых торговых условий или завышенного спреда - все счета являются стандартными и регистрируются с подачи автора системы через сайт Лепреконе.

Для получения всей информации Вам достаточно отправить запрос на e-mail: ealab@leprecontrading.com

С уважением, Администрация **LepreconTrading** ■

Михаил Трофимов (Hunter_GB)

Трейдер со стажем более 8 лет. В 2002 году начал разрабатывать для российского фондового рынка аналитические торговые системы, известные как "Gold Cross". С 2004 года торгует индексы, металлы, валютные пары, реже энергетику. Автор собственных разработок по торговым системам. Также занимается переводами, аналитическими обзорами, проведением тренингов по торговым системам.

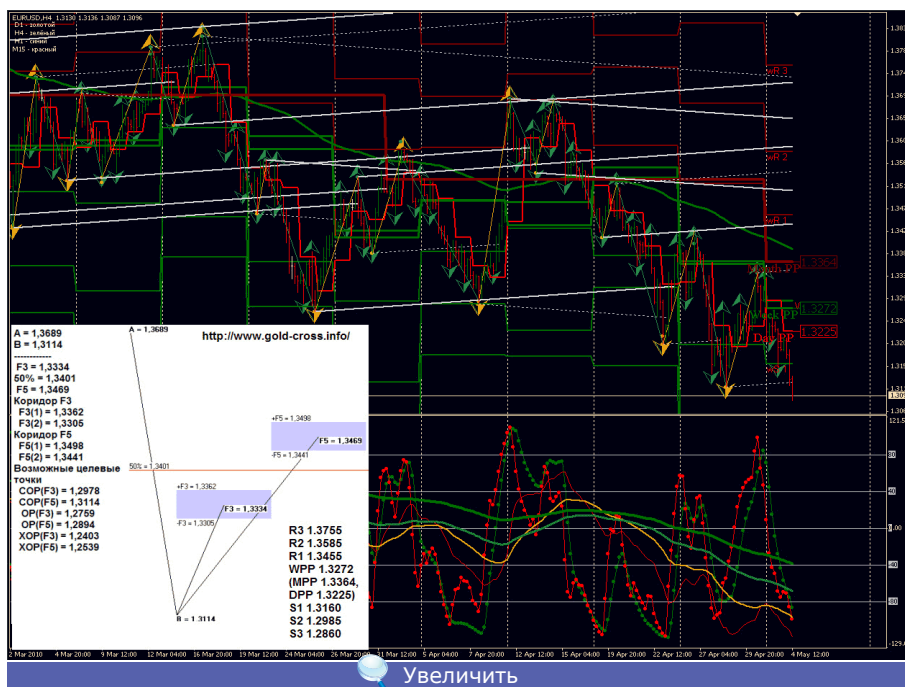
АНАЛИТИЧЕСКОЕ ИССЛЕДОВАНИЕ РЫНКА ИТОГИ АПРЕЛЬ 2010 ПРОГНОЗ МАЙ 2010

(ПО МАТЕРИАЛАМ РОССИЙСКИХ И ИНОСТРАННЫХ СМИ)

Европейский рынок акций и облигаций сдержанно отреагировал на решение МВФ и стран Еврозоны выделить крупный кредит для спасения экономики Греции.

Соглашение о предоставлении Афинам 110 млрд. евро (около 146 млрд. долларов) в течение ближайших трех лет было ожидаемым. ЕС предоставит Афинам 80 млрд. евро, остальное выделит МВФ. Соглашение направлено на предотвращение банкротства Греции. Согласно последнему прогнозу греческого правительства, в 2010 году ВВП страны упадет на 4%. По тем же оценкам, национальный долг Греции, который сегодня составляет около 115% ВВП, к 2013 году возрастет до 149%, после чего прогнозируется его сокращение.

EUR/USD:



EURUSD (6E): Евро торгуется в понижающемся ценовом канале, который имеет две линии поддержки: 1.2875 и 1.2525 на 1 мая 2010 года. Основной торговый диапазон: 1.2855 – 1.3265.

Точка разворота находится на уровне MPP 1.3364, WPP 1.3272, DPP 1.3225.

Мнение: Продавать с целевыми точками 1.2855 и 1.2685.

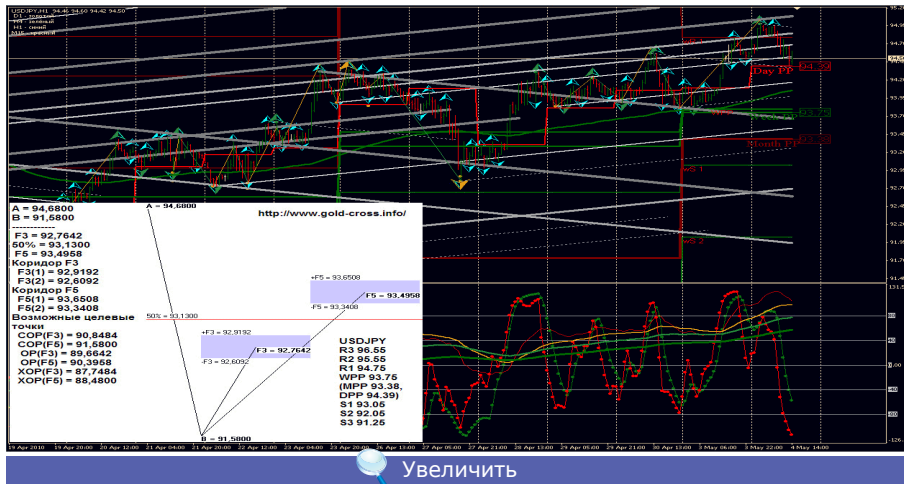
Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Даже не исключая возможности роста, следует отметить, что его продолжение будет незначительным из-за проблем Еврозоны.

Необходимо принимать во внимание, что материалы раздела «Аналитика» носят информационный характер и не являются четкими торговыми рекомендациями. Публикуемые рекомендации являются частным мнением аналитиков и не должны восприниматься как прямое руководство к действию. Редакция журнала «Leprecon Review» не несет ответственности за инвестиционные и прочие решения, принятые пользователями на основании информации, представленной в данном разделе, а также за результаты, полученные в ходе принятия таких решений.

USD/JPY (6J):

Менеджерам инвестиционного банка Goldman Sachs, который обвиняется в мошенничестве с ипотечными бумагами, пришлось выдержать серьезную головную боль во время слушаний в сенате США. Представители компании продолжают настаивать на своей невинности, но делать это им становится все сложнее. В то же время экономика США восстанавливается более быстрыми темпами, чем это было в 2004 г. Банковский сектор США не ужесточил условия кредитования. Проблемы с ипотечными долгами все еще актуальны. **Занятость населения увеличилась.**



Увеличить

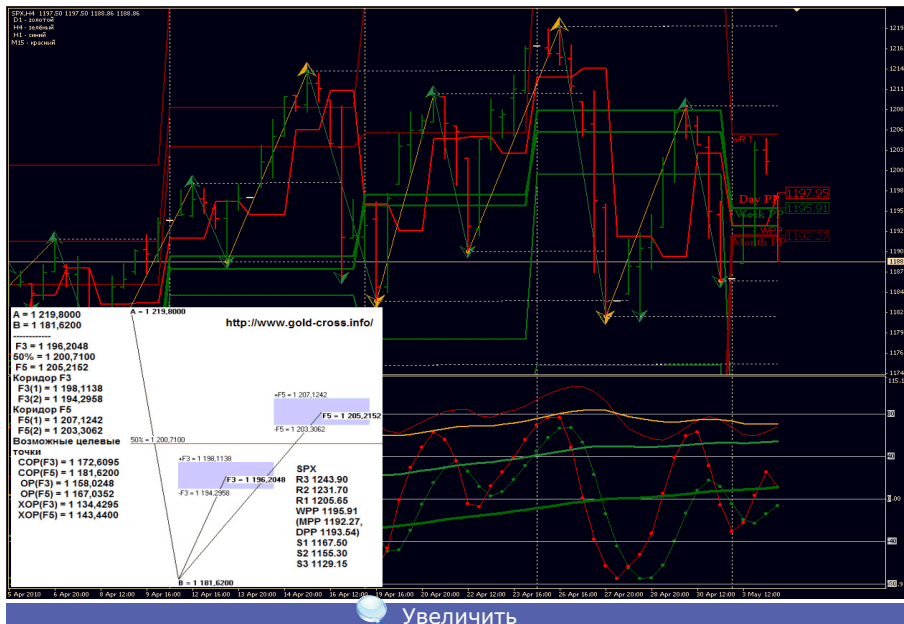
USDJPY: Рост доллара ограничен до 95.55/96.55 — два уровня сопротивления до 1 июня 2010 года. **Основной торговый диапазон:** 94.75 – 92.75. Точка разворота находится на уровне WPP 93.75, MPP 93.38, DPP 94.39.

Мнение: Торговать в диапазоне 94.75 – 92.75.

Альтернативный сценарий: продавать от 96.75 и покупать от 90.25.

Анализ: Доллар торгуется в зоне консолидации, возможны технические коррекции.

SPX:



Увеличить

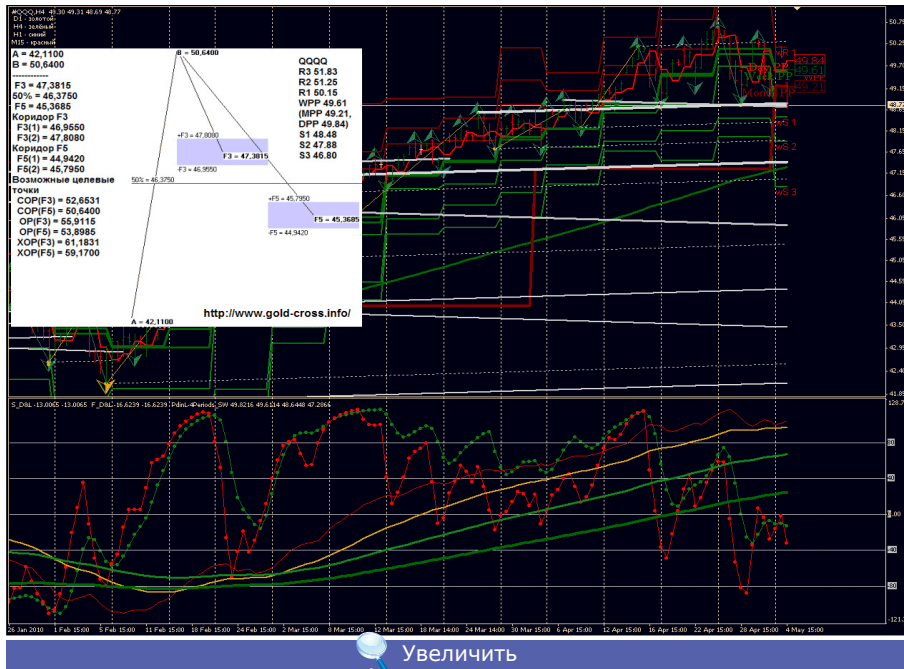
SPX (S&P 500) (globex): основное сопротивление на уровнях 1170.00 и 1155.00. Основной торговый диапазон: 1180.00 и 1155.00. Точка разворота находится на уровне MPP 1192.27, WPP 1195.91, DPP 1193.54.

Мнение: Продавать от 1190.00 с целевыми точками 1150.00 и 1060.00.

Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Даже не исключая возможности роста, следует отметить, что его продолжение будет незначительным. Замедление роста ВВП США во 2-м квартале. Сезонная занятость населения увеличивается.

POWERSHARES QQQQ (NASDAQ):



Powershares QQQQ (nasdaq): Рост ограничен до 49.95, открытие продаж. Основной торговый диапазон: от 46.70 до 45.50.

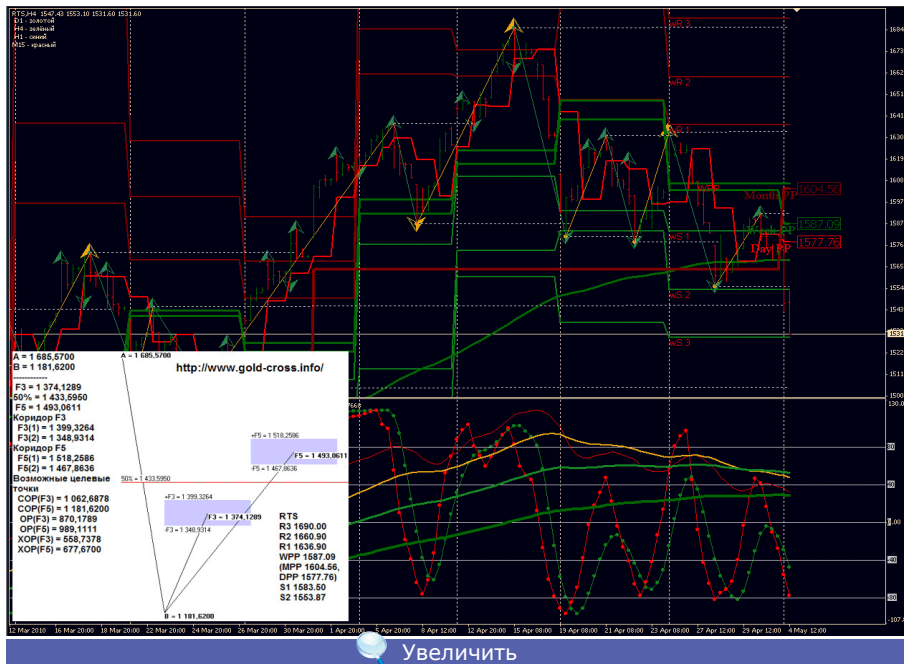
Точка разворота находится на уровне MPP 49.21, WPP 49.61 и DPP 49.84.

Мнение: Продавать от 49.95 с целевыми точками 46.05 и 42.70.

Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Сезонное затишье.

RTS (RUSSIA):



RTS (Russia): Тренд вниз. Возможен тренд до 1425.00/1375.00. Основной торговый диапазон: от 1570.00 до 1505.00.

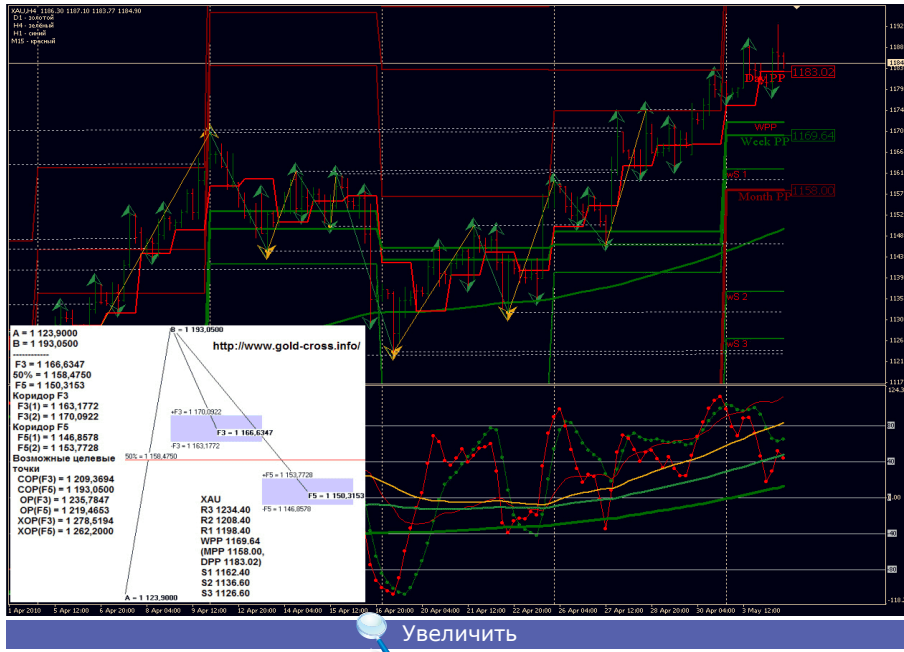
Точка разворота находится на уровне MPP 1604.56, WPP 1587.09, WPP 1587.09 и DPP 1577.76.

Мнение: Продавать от текущих уровней с целевой точкой 1365.00.

Альтернативный сценарий: возможна коррекция до 1570.00.

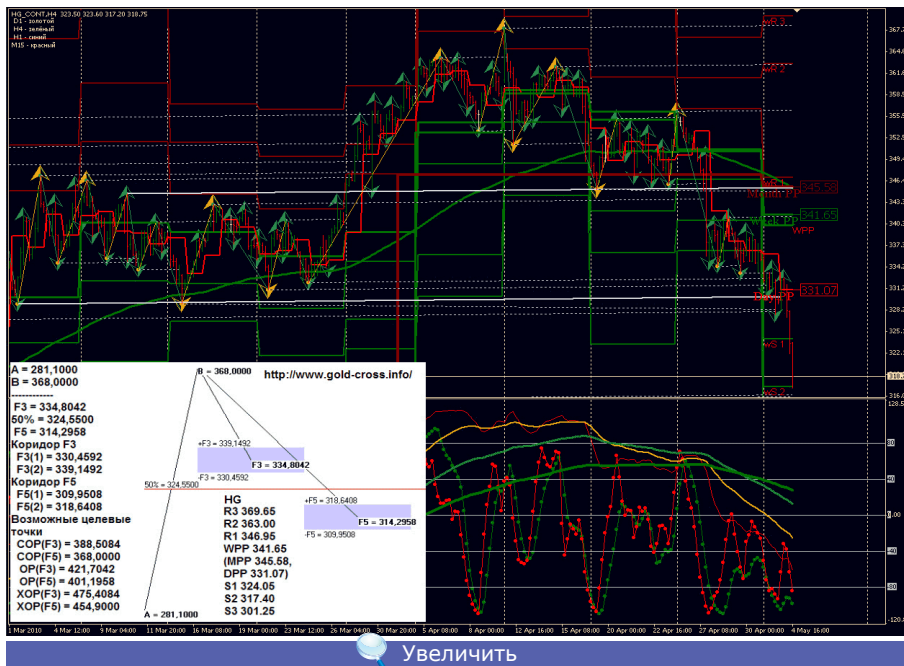
Анализ: Сезонная коррекция.

GOLD (XAU - spot):



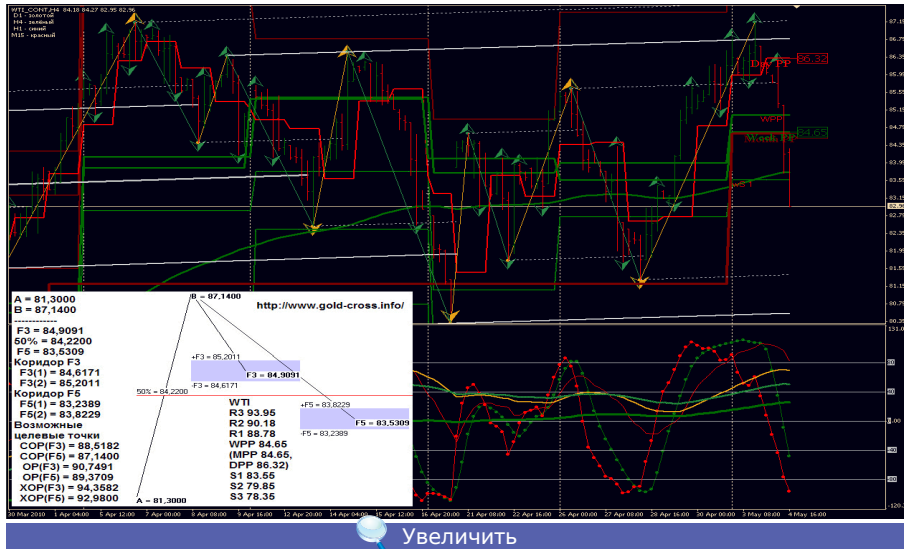
GOLD (XAU - spot): Коррекционное снижение, возможно до 1145.00 – 1114.00. Покупки от 1085.00/1092.00.
Точка разворота находится на уровне MPP 1158.00, WPP 1169.64 и DPP 1183.02.
Мнение: Инструмент находится в торговом диапазоне, причин для выхода за ценовые уровни пока нет.
Альтернативный сценарий: отсутствует.
Анализ: Торговать в обозначенном диапазоне.

COPPER (HG - COMEX):



Падение цен на сырье обусловлено увеличившимися запасами и ростом доллара.
COPPER (HG - comex): Тренд вниз, консолидация на уровне 308.00. Основной торговый диапазон 308.00 – 340.00.
Мнение: Продавать от 348.00 с целевыми точками 308.00 и 296.00.
Альтернативный сценарий: отсутствует. Разворотные уровни MPP 355.00 и WPP 358.40.
Анализ: Сезонный спрос.

CRUDE OIL (WTI - ICE):



WTI: Торговый диапазон 79.00 – 83.00, сезонная консолидация. Сезонный тренд, который продлится до сентября с небольшими коррекциями.

Точка разворота находится на уровне MPP 84.65, WPP 84.65 и DPP 86.32.

Мнение: Сезонный тренд, ожидается падение цены до уровня 65.00 – 75.00. Следует принимать во внимание возможность перехода на взаиморасчеты между странами, минуя доллар США. Торговать в обозначенном диапазоне.

Альтернативный сценарий: принимая во внимание разлив нефти у побережья США, торговать нефтепродуктами следует с особой осторожностью.

Анализ: Недавняя катастрофа в США - разлив нефти - может привести к ускоренной разработке альтернативных источников энергии.

NATURAL GAS (NG - nymex):



NG: Торговый диапазон 3.870 – 4.400, тенденция к повышению. Сезонный тренд, увеличение спроса.

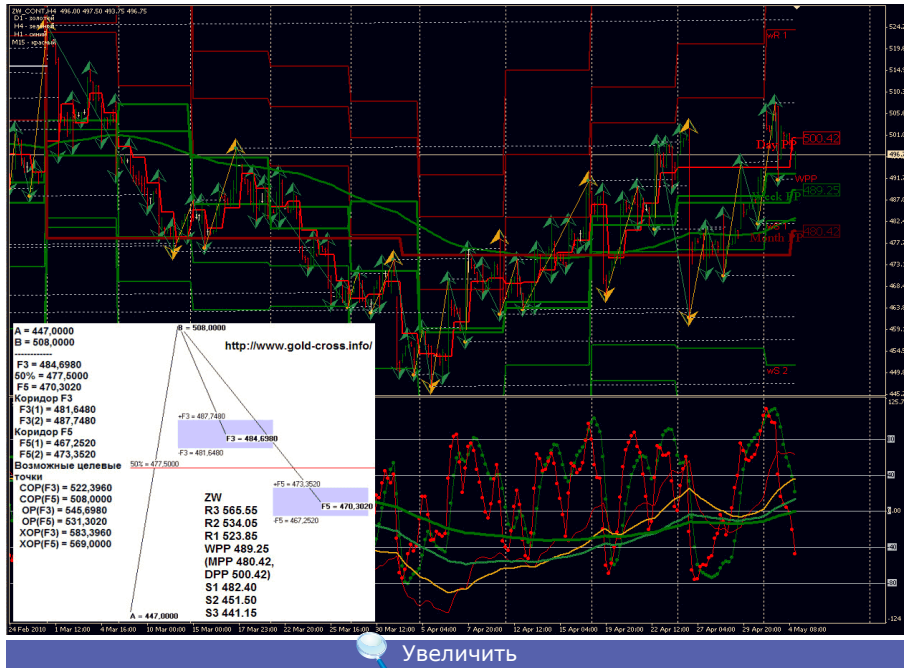
Точка разворота находится на уровне MPP 4.042, WPP 4.063 и DPP 3.970.

Мнение: Торговать в обозначенном диапазоне.

Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Разработка новых технологий переработки сырья и перевод потребителей на продукты глубокой переработки NG.

WHEAT (ZW - ecbot):



ZW: Консолидация. Достигнута низшая цена в сезонной торговле. Основной торговый диапазон 447.00 – 525.00.

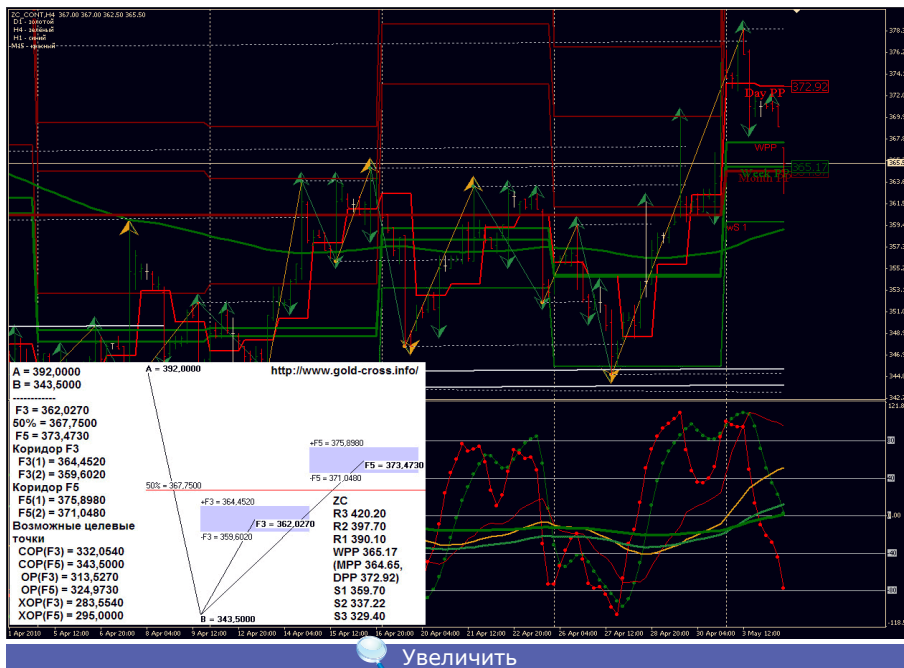
Точка разворота находится на уровне MPP 480.42, WPP 489.25 и DPP 500.42.

Мнение: Покупать от 450.00 со стопами ниже 439.00.

Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Сезонная активность, возможен повышенный спрос.

CORN (ZC - ecbot):



ZC: Консолидация. Достигнута низшая сезонная цена 302.00. Ожидание данных по возможному урожаю. **Основной торговый диапазон:** 310.00 – 370.00.

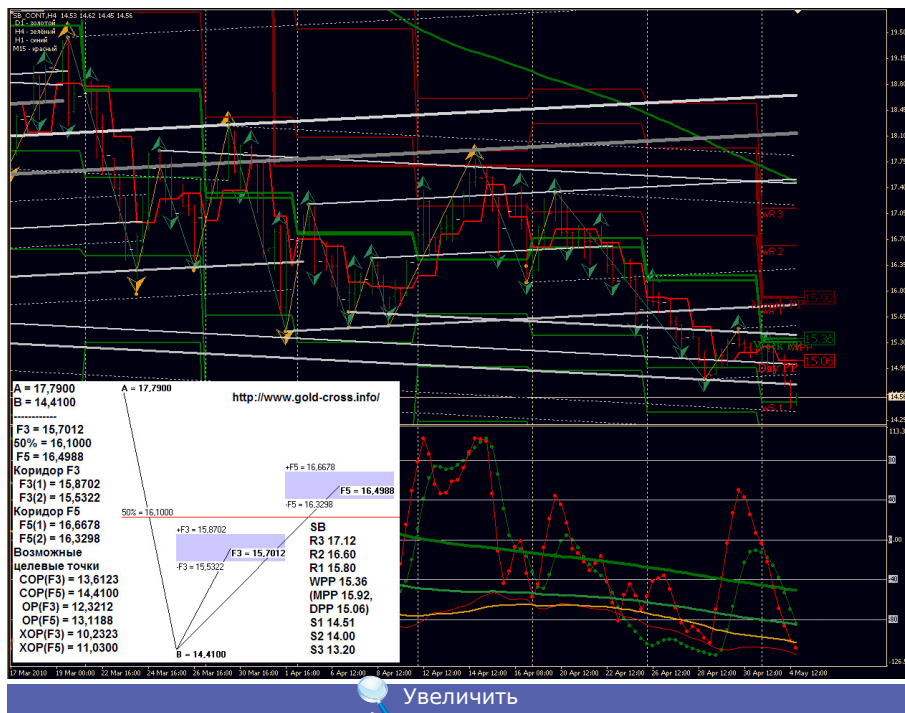
Точка разворота находится на уровне MPP 364.65, WPP 365.17, DPP 372.92.

Мнение: Сезонная активность, ожидание данных по возможному урожаю.

Альтернативный сценарий: отсутствует.

Анализ: Сезонная активность, возможен повышенный спрос.

SUGAR (SB - ICE):



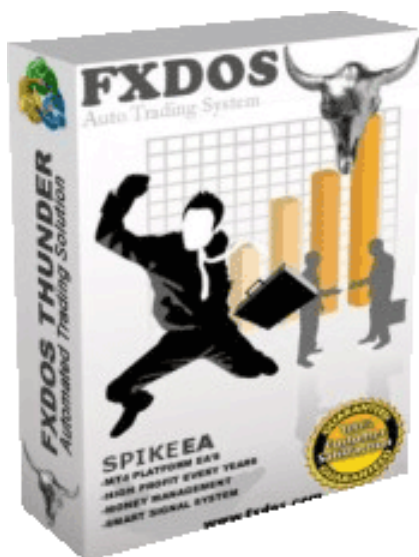
SB: Флэт, который продлится до сентября, с небольшими коррекциями. Торговый диапазон — отсутствует.
Точка разворота находится на уровне MPP 15.92, WPP 365.17 и DPP 15.06.
Мнение: Вне рынка.
Альтернативный сценарий: Возможно падение цены от 16.10 до 9.75.
Анализ: Сезонная активность.

Удачи в торговле! ■





SPIKE EA



«SPIKE EA» назван самими разработчиками великолепной системой по той причине, что за 4 года данный советник не получил ни единого лосса.

Сайт: <http://www.fxdos.com/spike.html>

Платформа: MetaTrader 4

Стоимость лицензии: 390\$

Торгуемые пары: EUR/USD

Рабочий TF: H1

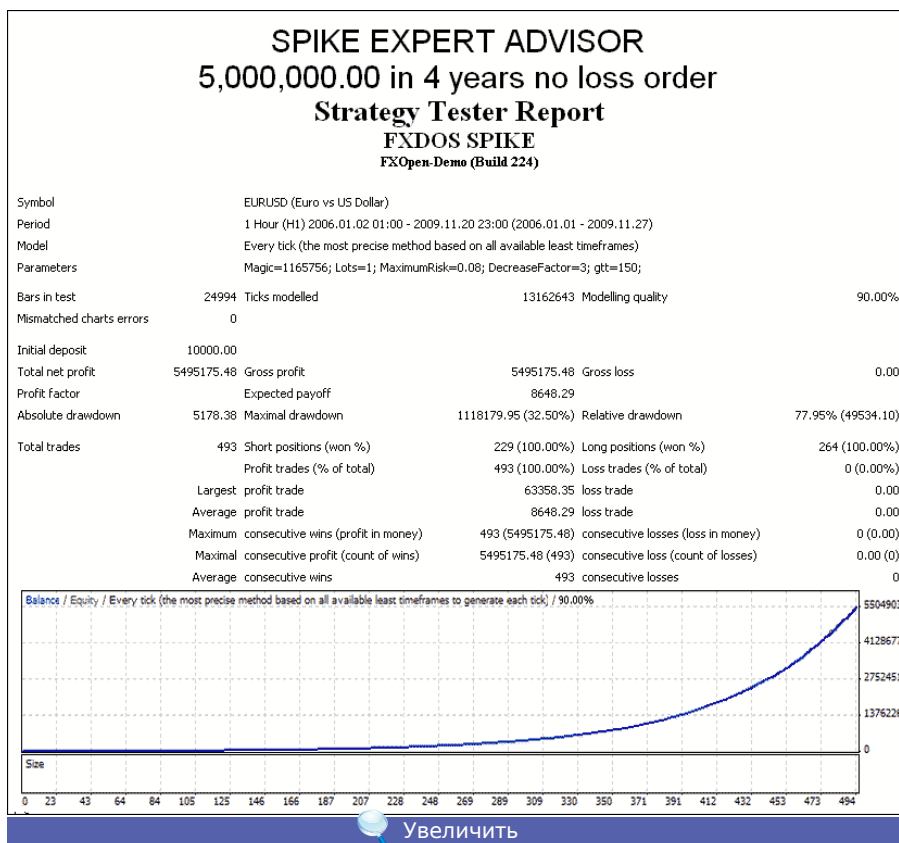
Начало мониторинга в Лаборатории: 1 февраля 2010 г.
<http://ealab.ru/ea.php?id=111>

Данный советник торгует на паре EUR/USD, потому что, по словам разработчиков, эта пара является мажором, и спред на ней небольшой. Отсутствие лоссов за 4 года скорее настораживает, чем радует – здесь может быть два варианта:

1 – Лоссы не ставятся вообще, и советник пересживает убытки «до потери пульса» (в нашем случае, Margin Call);

2 – Лоссы значительно превосходят профиты - т.е. это то же самое пересживание с иллюзией выставленных стопов. Стопы в таком случае выбираются прогоном советника на истории и выставлением максимально возможного за весь промежуток значения, в надежде, что в будущем стопы не станут больше.

Давайте посмотрим, что нам покажут разработчики:



К счастью, можно посмотреть детальный отчет, а не просто картинку с чудесным превращением тысяч в миллионы.

Смотрим, как открываются сделки. Сразу бросаются в глаза множественные удаления несработавших отложенных ордеров – их в разы больше, чем открывшихся.

Как же обстоят дела со стопами? В приведенном на сайте примере стопы выставляются, то есть это уже не описанный выше 1-й вариант. Посмотрим теперь на их размер. Как видим, одновременно открылось 3 сделки по одной цене. Стопы у них одинаковые и равны 239 пипсам. А профиты немного отличаются – у одного ордера это 10 пипсов, а у 2-х других – это 21 пипс. Таким образом, у первой сделки стоп превышает профит в 23,9 (!!!) раза, а во втором случае в 11,3 раз. Прямо скажем, соотношение пугающее... В итоге, мы видим, что в данном советнике применен второй метод обхода лоссов на истории, описанный выше.

26	2006.01.06 03:34	sell stop	14	0.80	1.1855	1.2095	1.1834		
27	2006.01.06 03:35	sell stop	15	0.80	1.1855	1.2095	1.1834		
28	2006.01.06 03:50	buy stop	16	0.80	1.2094	1.1855	1.2104		
29	2006.01.06 03:50	buy stop	17	0.80	1.2094	1.1855	1.2115		
30	2006.01.06 03:50	buy stop	18	0.80	1.2094	1.1855	1.2115		
31	2006.01.06 03:55	buy	16	0.80	1.2094	1.1855	1.2104		
32	2006.01.06 03:55	buy	17	0.80	1.2094	1.1855	1.2115		
33	2006.01.06 03:55	buy	18	0.80	1.2094	1.1855	1.2115		
34	2006.01.06 10:00	delete	13	0.80	1.1855	1.2095	1.1845		
35	2006.01.06 10:00	delete	14	0.80	1.1855	1.2095	1.1834		
36	2006.01.06 10:00	delete	15	0.80	1.1855	1.2095	1.1834		
37	2006.01.06 11:18	t/p	16	0.80	1.2104	1.1855	1.2104	80.00	10080.00
38	2006.01.06 15:31	t/p	17	0.80	1.2115	1.1855	1.2115	168.00	10248.00
39	2006.01.06 15:31	t/p	18	0.80	1.2115	1.1855	1.2115	168.00	10416.00
40	2006.01.09 05:11	sell stop	19	0.80	1.1897	1.2137	1.1887		
41	2006.01.09 05:17	sell stop	20	0.80	1.1897	1.2137	1.1876		
42	2006.01.09 05:21	sell stop	21	0.80	1.1897	1.2137	1.1876		
43	2006.01.09 08:54	buy stop	22	0.80	1.2142	1.1901	1.2152		
44	2006.01.09 08:54	buy stop	23	0.80	1.2142	1.1901	1.2163		
45	2006.01.09 08:54	buy stop	24	0.80	1.2142	1.1901	1.2163		
46	2006.01.09 10:00	delete	19	0.80	1.1897	1.2137	1.1887		
47	2006.01.09 10:00	delete	20	0.80	1.1897	1.2137	1.1876		
48	2006.01.09 10:00	delete	21	0.80	1.1897	1.2137	1.1876		
49	2006.01.09 10:00	delete	22	0.80	1.2142	1.1901	1.2152		
50	2006.01.09 10:00	delete	23	0.80	1.2142	1.1901	1.2163		
51	2006.01.09 10:00	delete	24	0.80	1.2142	1.1901	1.2163		

Увеличить

Посмотрим еще один фрагмент:

754	2006.04.17 10:00	delete	369	0.90	1.2007	1.2249	1.1986		
755	2006.04.18 03:00	buy stop	370	0.90	1.2276	1.2033	1.2286		
756	2006.04.18 03:00	buy stop	371	0.90	1.2276	1.2033	1.2297		
757	2006.04.18 03:00	buy stop	372	0.90	1.2276	1.2033	1.2297		
758	2006.04.18 03:00	sell stop	373	0.90	1.2033	1.2276	1.2023		
759	2006.04.18 03:00	sell stop	374	0.90	1.2033	1.2276	1.2012		
760	2006.04.18 03:00	sell stop	375	0.90	1.2033	1.2276	1.2012		
761	2006.04.18 04:19	buy	370	0.90	1.2276	1.2033	1.2286		
762	2006.04.18 04:19	buy	371	0.90	1.2276	1.2033	1.2297		
763	2006.04.18 04:19	buy	372	0.90	1.2276	1.2033	1.2297		
764	2006.04.18 10:00	delete	373	0.90	1.2033	1.2276	1.2023		
765	2006.04.18 10:00	delete	375	0.90	1.2033	1.2276	1.2012		
766	2006.04.18 10:00	delete	374	0.90	1.2033	1.2276	1.2012		
767	2006.04.18 15:53	t/p	370	0.90	1.2286	1.2033	1.2286	90.00	11459.70
768	2006.04.18 15:55	t/p	371	0.90	1.2297	1.2033	1.2297	189.00	11648.70
769	2006.04.18 15:55	t/p	372	0.90	1.2297	1.2033	1.2297	189.00	11837.70
770	2006.04.20 03:25	sell stop	376	0.90	1.2111	1.2356	1.2101		
771	2006.04.20 03:26	sell stop	377	0.90	1.2111	1.2356	1.2090		
772	2006.04.20 03:26	sell stop	378	0.90	1.2111	1.2356	1.2090		
773	2006.04.20 03:34	buy stop	379	0.90	1.2356	1.2111	1.2366		
774	2006.04.20 03:34	buy stop	380	0.90	1.2356	1.2111	1.2377		

Увеличить

В данном примере стоп еще больше и равен 253 пипсам при тех же тейках, т. е. соотношение профита к лоссу, в данном случае, еще хуже и для первой сделки равно 25,3.

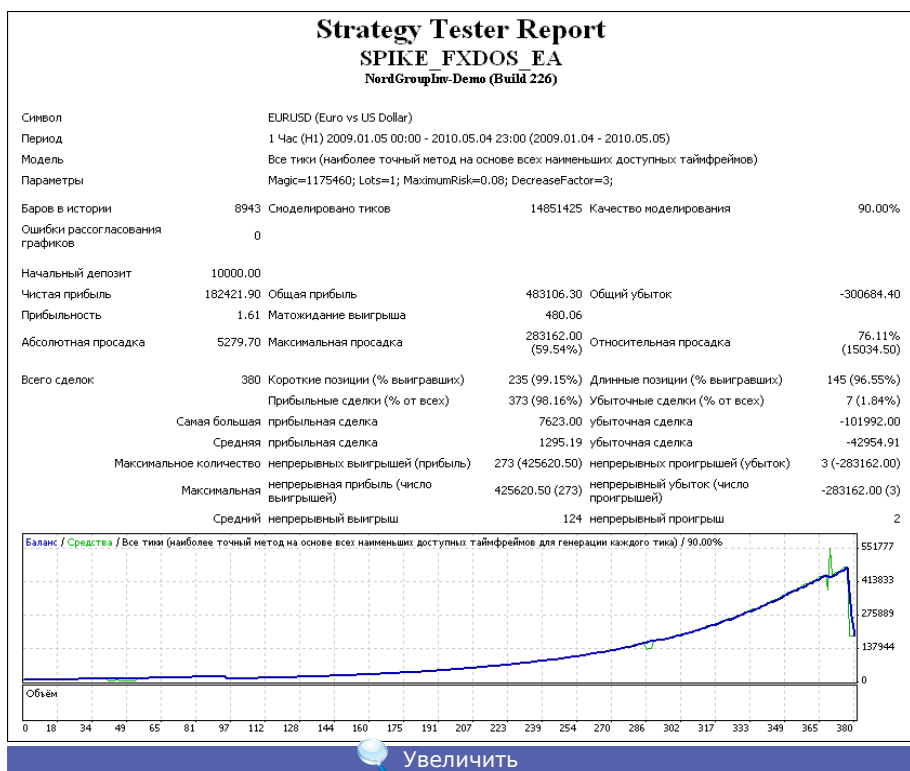
Больше на сайте ничего интересного нам обнаружить не удалось, поэтому переходим непосредственно к советнику.

Рассмотрим настройки советника:

- **Magic** – уникальный Magic советника – не должен совпадать с Magic других советников (при использовании нескольких советников на одном счете);
- **Lots** – лот для торговли;
- **MaximumRisk** – максимальный риск;
- **DecreaseFactor** – коэффициент уменьшения лота в зависимости от результата предыдущих сделок.

Вот и все настройки, перейдем теперь к тестированию.

Посмотрим тест с января 2009 г. по 4 мая 2010 г.:



Увеличить

Как видим, 21 апреля 2010г. советник «нарывается» на те самые огромные лоссы, причем, всеми тремя ордерами, что приводит к потере половины всего заработанного.

3935	2010.04.21 03:00	sell stop	1662	8.30	1.3352	1.3622	1.3342		
3936	2010.04.21 03:00	sell stop	1663	8.40	1.3352	1.3622	1.3331		
3937	2010.04.21 03:00	sell stop	1664	8.40	1.3352	1.3622	1.3331		
3938	2010.04.21 10:00	delete	1662	8.30	1.3352	1.3622	1.3342		
3939	2010.04.21 10:00	delete	1664	8.40	1.3352	1.3622	1.3331		
3940	2010.04.21 10:00	delete	1663	8.40	1.3352	1.3622	1.3331		
3941	2010.04.21 13:33	sl	1650	38.00	1.3362	1.3362	1.3642	-101992.00	373591.90
3942	2010.04.21 13:33	sl	1651	38.00	1.3362	1.3362	1.3653	-101992.00	271599.90
3943	2010.04.21 13:33	sl	1652	29.50	1.3362	1.3362	1.3653	-79178.00	192421.90
3944	2010.04.22 03:00	buy stop	1665	0.10	1.3600	1.3330	1.3610		
3945	2010.04.22 03:00	buy stop	1666	0.10	1.3600	1.3330	1.3621		

Увеличить

Кстати, исходя из этих данных, можно сделать вывод о том, что советник оптимизировали до этой даты - поэтому разработчики не учли такой лосс. Есть вероятность, что в следующей версии советника, торгующего, по словам авторов, без лоссов, будет стоять еще больший уровень стоп-лосса, что позволит избежать его срабатывания.

Посмотрим теперь картинку с тестера:



Увеличить

Теперь понятно, почему так много несработавших ордеров в стейте. Советник ставит отложенные ордера по краям канала, построенного Envelopes, в ожидании их пробития и удаляет отложенные ордера, если пробития не произошло. И, к сожалению, видим, что настройки индикаторов скрыты от пользователя – соответственно, нет возможности их оптимизировать.



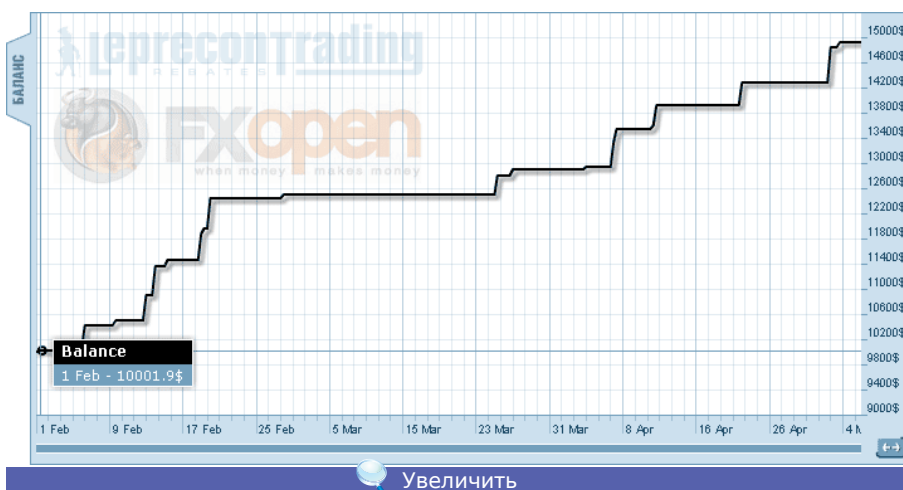
Увеличить

Вот так происходило срабатывание лоссов в тестере:



Обратимся теперь к нашей Лаборатории (<http://ealab.ru>), в которой советник торгует с 1 февраля 2010 г.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	SPIKE EA	580	14,911.10	14,911.10	93 дней



Удивительно, но нет того лосса, который мы видели в тестере. Более того, 21 апреля, когда были получены лоссы в тестере, вообще нет сделок:

34778037	2010.04.08 09:24	sell	1	eurusd	1.3303	0	1.3293	2010.04.08 09:04	1.3293	0	0	10	100
34779137	2010.04.08 09:24	sell	1.1	eurusd	1.3303	0	1.3282	2010.04.22 16:04	1.3282	0	-45.24	21	231
34779195	2010.04.08 09:24	sell	1.1	eurusd	1.3303	0	1.3282	2010.04.22 16:04	1.3282	0	-45.24	21	231
34800340	2010.04.08 09:58	sell	1	eurusd	1.3295	0	1.3285	2010.04.08 10:04	1.3285	0	0	10	100
35103961	2010.04.13 08:13	buy	0.6	eurusd	1.3605	1.3336	1.3615	2010.04.13 08:04	1.3615	0	0	10	60
35104001	2010.04.13 08:13	buy	0.6	eurusd	1.3605	1.3336	1.3626	2010.04.13 15:04	1.3626	0	0	21	126
35104027	2010.04.13 08:13	buy	0.6	eurusd	1.3605	1.3336	1.3626	2010.04.13 15:04	1.3626	0	0	21	126
35117295	2010.04.13 09:00	buy	0.5	eurusd	1.3614	1.3344	1.3624	2010.04.13 15:04	1.3624	0	0	10	50
36547613	2010.04.29 03:27	sell	1.1	eurusd	1.3184	0	1.3174	2010.05.03 16:05	1.3174	0	-6.46	10	110
36547625	2010.04.29 03:27	sell	1.1	eurusd	1.3184	0	1.3163	2010.05.03 17:05	1.3163	0	-6.46	21	231
36547633	2010.04.29 03:27	sell	1.1	eurusd	1.3184	0	1.3163	2010.05.03 17:05	1.3163	0	-6.46	21	231

О чем это может говорить? Советник зависим от котировок и на разных счетах может вести себя по-разному.

Выводы: Использование данного советника на реальном счете сопряжено с рядом рисков:

- зависимостью от котировок, ввиду чего нельзя быть уверенным, откроются на данном счете именно те убыточные сделки или они будут пропущены (как в нашем случае в Лаборатории);
- открытием в тот момент, когда еще не наработана прибыль, и получением огромного лосса.

К плюсам советника, пожалуй, можно отнести только простоту установки

Основные минусы советника:

- плохое соотношение профит/лосс, в результате чего убыточная сделка приводит к большой просадке, в надежде на то, что не произойдет лосса, превышающего заданный;
- скрытые настройки как индикаторов, применяемых в советнике, так и параметров лосса и тейков, и, как следствие, невозможность их оптимизации;
- высокая стоимость лицензии.

Удачи и профитов! ■



USDBOT
**REAL MONEY
REAL RESULTS**

- ✓ Proven Profit With Real Money
- ✓ 2 Years Of Research & Perfection
- ✓ Hassle-Free Automated Trading
- ✓ No Forex Experience Needed
- ✓ 5-Minute Fast Installation
- ✓ FREE Lifetime Upgrades

**EXCLUSIVE
NEW "NAC"
TECHNOLOGY**

SICK OF LOSING MONEY IN FOREX?

USDBOT

«USDBOT» торгует на парах EUR/USD и USD/JPY. Робот создан группой ветеранов Форекса после многих лет исследований и тестирования.

Разработчик: Mark Trenton
Сайт: <http://www.usdbot.com>
Платформа: MetaTrader 4
Стоимость лицензии: 149\$
Размер дистрибутива: 900 кБ
Торгуемые пары: EUR/USD и USD/JPY
Рабочий ТФ: H1
Версия: 2.0

Начало мониторинга в Лаборатории: 3 февраля 2010 г.
<http://ealab.ru/ea.php?id=110>

Идём на сайт разработчика и - это уже становится какой-то традицией - видим следующую надпись:

USDBOT Is Currently SOLD OUT.
Please Join The VIP Waiting List Below.

Join Our **VIP** List
 Exclusive Updates, Discounts

Email:

Sign Up!

**REAL MONEY
REAL RESULTS**

«USDBOT» уже, оказывается, распродан, и купить его нельзя. В прошлом номере «Leprecon Review» (<http://forum.leprecontrading.com/download/file.php?id=1358&sid=c0fe27c665f7a72aa6bb24f0504720ae>) мы уже сталкивались с подобным явлением – речь шла о советниках с

так называемого чемпионата «**FRWC's Royal Trader**». Похоже, таким образом разработчики решили защитить рынок от разорения, которое обязательно бы наступило при использовании их советников :))

Впрочем, в данном случае не будем спешить с выводами и продолжим изучение «USDBOT». Для начала, не боясь спама и прочих чудес, забиваем наш e-mail в поле «Подписка» и жмем Sign Up.

Кто же откажется присоединиться к VIP-листу и иметь эксклюзивные скидки и обновления? - а именно так написано вверху окошка, в котором вводится e-mail.

You're Almost Done - Activate Your Subscription!

You've just been sent an email that contains a **confirm link**.

In order to activate your subscription, check your email and click on the link in that email. You will not receive your subscription until you **click that link to activate it**.

If you don't see that email in your inbox shortly, fill out the form again to have another copy of it sent to you.



Подтверждаем подписку по пришедшему на e-mail линку... и попадаем на выше упомянутый сайт чемпионата «**FRWC's Royal Trader**».

Что же получается - «USDBOT» тоже замешан в этих делах? :)

В любом случае, подписка подтверждена – путь к спаму открыт... Ждем...

Hello,

Thank you for confirming your e-mail address. You have been added to our exclusive VIP List. Please make sure to add our e-mail address to your address book so that we can easily reach you in the coming days.

Best Wishes,
Mark Trenton
USDBOT Support
www.USDBOT.com

Flat 7 Kerrington Court, 148 Uxbridge Road, London, W12 8AA UK

To unsubscribe or change subscriber options visit:
<http://www.aweber.com/z/r/?jIys7ByMjLQsbEzMjOyMbLRmtKyMLExsjIw=>

Все, нас посчитали и успокоили, что теперь наш e-mail надежно запомнился в чьей-то базе, и все будет хорошо. Обратите внимание, что существует возможность отписаться от рассылки – по крайней мере, ссылка для этого прилагается – проверять ее мы не стали. Возможно, кто-то из пытливых читателей не поленится набрать эту строчку в своем браузере и оставит нас, таким образом, без подписки :))

Ладно, оставим пока подписку и обратимся к советнику, который мы, конечно же, приобрели заранее.

В комплект входит множество буклетиков – Управление рисками, Успешная торговля и прочее, в которых вы можете ознакомиться как с правилами ММ, так и с основными правилами успешного трейдера.

Нас же больше интересует непосредственно инструкция к самому советнику - **USDBOTGUIDE.pdf**. По сути, большая часть описания касается процесса установки советника в терминал. Настройки советника не рассмотрены. Из интересного можно отметить один момент. Автор пишет, что советник предназначен для работы на парах EUR/USD и USD/JPY на тайм-фрейме D1, но добавляет, что если советник за 72 часа не открыл ни одной сделки, то можно попробовать перевести его на часовой тайм-фрейм (H1).

Настройки советника:

LotSize – величина лота для торговли;

StopLoss – уровень стоп-лосса;

TakeProfit – уровень тейк-профита;

Slippage – проскальзывание в пипсах для открытия/закрытия сделок;

MagicNumber – уникальный Magic советника – не должен совпадать с Magic других советников (при использовании нескольких советников на одном счете).

Вот, собственно, и все настройки. Перейдем теперь к тестам.

Хотим обратить ваше внимание на тот факт, что, несмотря на то, что в параметрах нет никаких переменных, относящихся к ММ, торговать советником постоянным лотом у вас не получится, так как после каждой убыточной сделки советник без спроса удваивает лот для последующего входа, в надежде отыграть минус. В итоге, при лоте 0,1, выставленном в настройках, мы наблюдали и лот 1,6, и даже 3,2.

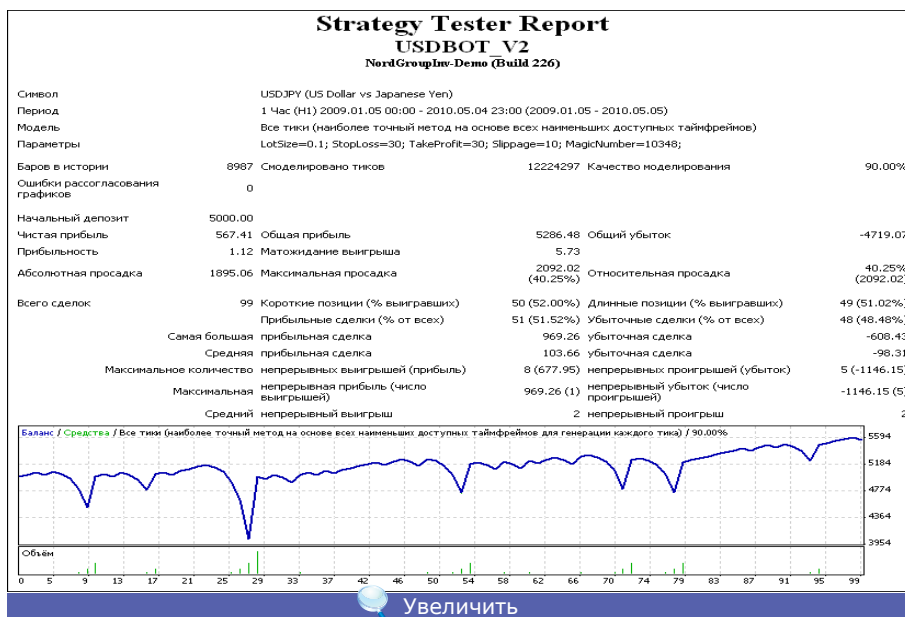
Имейте это в виду, когда будете ставить советник на счет!

Смотрим USD/JPY. Что же мы видим – весь журнал испещрен сообщениями об ошибках:

2010.04.22 17:00	USDBOT_V2 USDJPY,H1: OrderSend error 4107
2010.04.22 16:00	USDBOT_V2 USDJPY,H1: OrderSend error 4107
2010.04.22 15:00	USDBOT_V2 USDJPY,H1: OrderSend error 4107
2010.04.22 14:00	USDBOT_V2 USDJPY,H1: OrderSend error 4107
2010.04.22 09:00	USDBOT_V2 USDJPY,H1: OrderSend error 4107

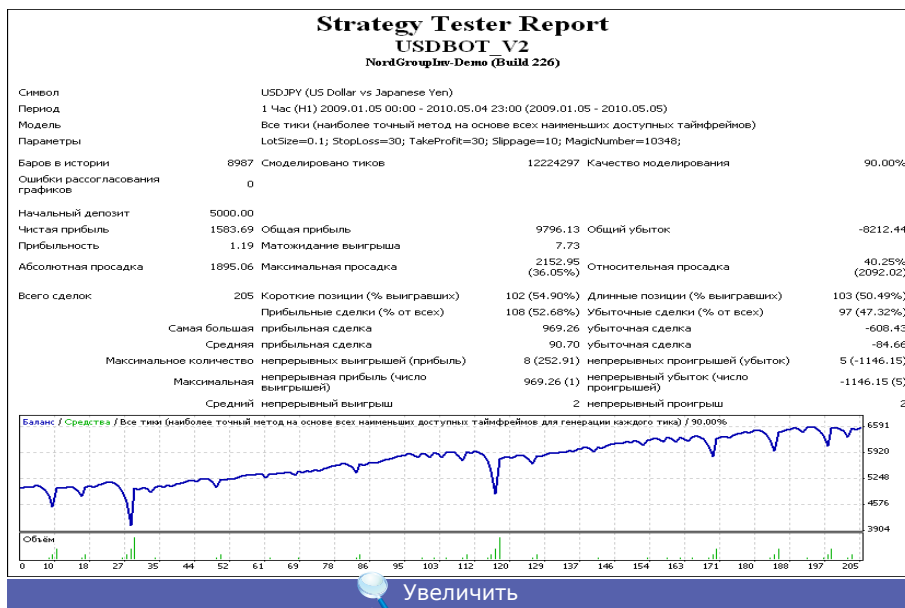
4107 – этот номер ошибки означает, что, при попытке открытия сделки, поступают неправильные параметры цены, и советник выдает ошибку.

Вот как при этом выглядят результат тестирования:



Стыдно, господа разработчики! На дворе XXI век – нужно всего лишь нормализовать цену, чтобы на входе процедуры OrderSend цена была правильная. Это же совсем не сложно!

Итак, советник имеет элементы конструктора, и код нужно доводить «до ума». Делаем это сами и тестируем снова:

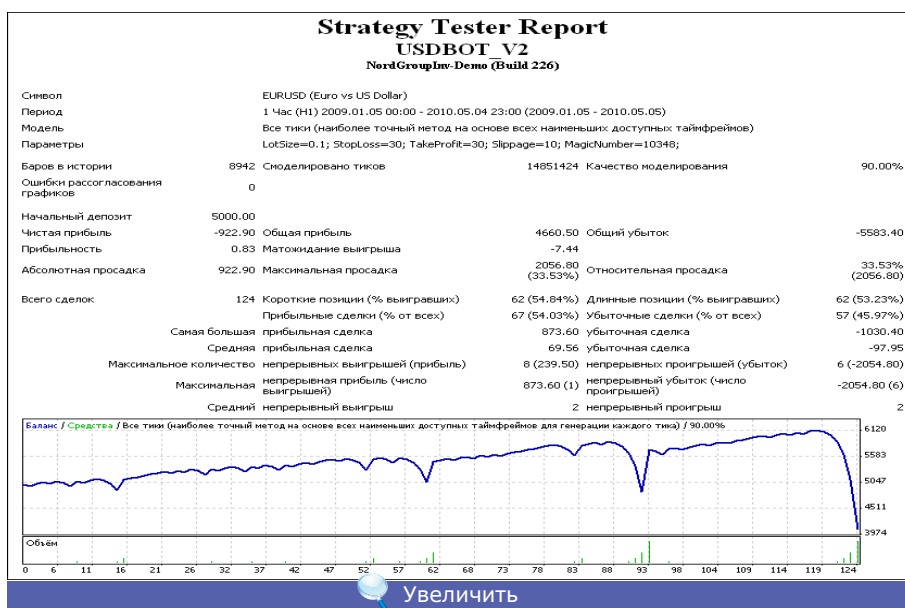


Так-то лучше! Вместо 567 получили 1583 доллара чистой прибыли. При этом просадка уменьшилась с 40.25% до 36% - мелочь, а приятно. Сделок стало в 2 раза больше – логично, раньше неправильная цена не давала открыться ордерам. И все же, это более чем скромный результат, если вспомнить, как активно советник увеличивает лоты, подвергая риску депозит.

Тестирование проводилось на последних 16 месяцах истории с января 2009 г. В месяц советником открывается в среднем всего 12 сделок, что для профита и лосса, равным 30, конечно, маловато. Трендовым данный советник можно назвать с большой натяжкой – если он и ищет тренд, то берет крайне малую его часть. Для скальпера же количество ордеров уж слишком мало.

Среднее количество пипсов, заработанное советником за месяц по паре USD/JPY на периоде H1, составило 98,9.

Перейдем теперь к тестированию на паре EUR/USD:



В итоге, чтобы преодолеть исторический отрезок с января 2009 г. по май 2010 г., советнику не хватило стартового капитала 5000\$. Как уже отмечалось выше, советник удваивает лот при каждой убыточной сделке. Вот последние сделки советника перед стопом:

2009.07.14 16:56	sell	122	0.80	1.3941	1.3941	1.4002	-269.60
2009.07.14 17:00	sell	123	1.60	1.39426			
2009.07.14 17:00	modify	123	1.60	1.39426	1.3976		
2009.07.14 17:00	modify	123	1.60	1.39426		1.3916	
2009.07.14 17:00	modify	123	1.60	1.39426	1.3975		
2009.07.14 17:46	sell	123	1.60	1.3975	1.3975	1.3916	-518.40
2009.07.14 18:00	buy	124	3.20	1.39732			
2009.07.14 18:00	modify	124	3.20	1.39732	1.3940		
2009.07.14 18:00	modify	124	3.20	1.39732		1.4000	
2009.07.14 18:00	modify	124	3.20	1.39732		1.4000	
2009.07.14 19:23	sell	124	3.20	1.3941	1.3941	1.4000	-1030.40

Увеличить

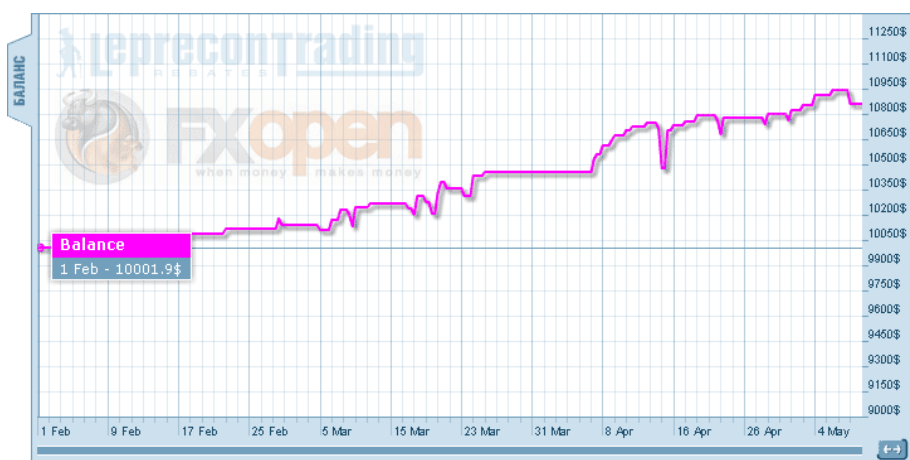
Мы видим череду убыточных сделок, лот, который «задран» до 3.2, и вот он - печальный итог - советник «слетает» с дистанции.

Также стоит отметить, что средний непрерывный выигрыш равен среднему непрерывному проигрышу и составляет 2. Если бы это соотношение было в пользу выигрышей, то, в этом случае, использование удвоения лота после лосса было бы более оправданным, так как шанс получить прибыльную сделку был бы выше.

Теперь идем в нашу [Лабораторию](#).

Советник «**USDBOT**» мониторится на реальном счете 96 дней. Заработанных пипсов 116. Депозит увеличен на 8%.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Зивити	Общее время теста
	USDBOT	116	10,856.60	10,856.60	96 дней



Пока дела советника идут неплохо. Больших прибылей он, конечно, не показывает, результат пока довольно скромный - прирост 8% к начальному депозиту за чуть более чем 3 месяца работы. Но, тем не менее, идет рост. Как будут складываться дела советника дальше, приглашаем Вас оценить в нашей Лаборатории <http://ealab.ru/ea.php?id=110>

Выводы:

Использовать советник на реальном счете - достаточно рискованная затея, т.к.:

- 1 - Советник не проходит тестирование на продолжительном отрезке истории. Стоп 30 пипс для ТФ Н1 - явная оптимизация под небольшой исторический отрезок;
- 2- Невозможно отключить удваивание лотов после каждой убыточной сделки или хотя бы ограничить максимально возможный лот.

В совокупности эти два пункта могут составить весьма неприятную картину, когда советник

получит ряд стопов один за другим (как было в нашем тесте по EUR/USD), и, в итоге, ему не хватит депозита для открытия новой позиции, так как лот превысит возможности депозита.

При всем при этом, ожидаемый профит советника не соответствует возможному риску.

Плюсы советника:

- простота настроек;
- жесткий (не скрытый) уровень лосса;

Минусы советника:

- принудительное удвоение лота после лосса с невозможностью отключения или контроля максимально возможного лота;
- подгонка уровней стопа и профита под короткий временной отрезок;
- высокая стоимость лицензии - особенно, с учетом того, что код имеет, как минимум, одну недоработку (описана выше), приводящую к некорректному функционированию советника.

Удачи и профитов! ■





FXopen
when money makes money

Присоединяйтесь к **MT4 ESN**
революции сегодня!

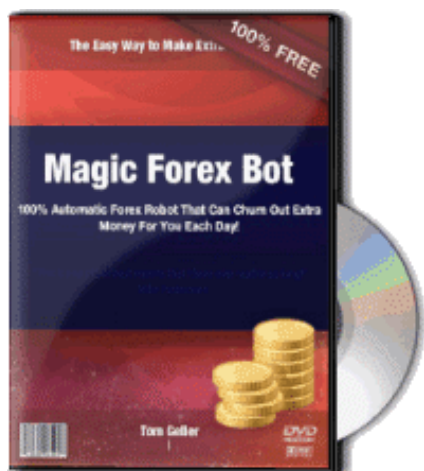
Торгуйте не против
вашего брокера,
а с другими трейдерами!
Прямой доступ
к межбанковской ликвидности.

Платите только фиксированную комиссию без
каких-либо добавок к спреду, работает со всеми EA.

Скальпинг разрешен
и приветствуется!



MAGIC FOREX BOT



«Magic Forex Bot» торгует на паре EUR/USD и, по словам разработчика, должен приносить 50 пипсов прибыли каждый день.

Разработчик: Tom Geller
Сайт: <http://www.pipsleader.com/magicforexbot>
Платформа: MetaTrader 4
Стоимость лицензии: 97\$
Размер дистрибутива: 820 кБ
Торгуемые пары: EUR/USD
Рабочий TF: H1
Версия: 1.0

Начало мониторинга в Лаборатории: 19 апреля 2010 г.
<http://ealab.ru/ea.php?id=141>

Заявленные разработчиком преимущества советника:

- Высокая профитность – в среднем, 50 пипсов в день;
- Система «поставил и забыл» - хороша для людей, занятых другой работой;
- Не требует ручного вмешательства;
- Не требует опыта торговли;
- Новинка, не похожая ни на один из советников;
- Для свободного скачивания доступно ограниченное количество копий советника.

0.89619	0.87950	0.90030	2009.11.04 00:10	0.89661	-23.10	0.00	0.16	96.52
1.68600	1.70160	1.68200	2009.11.04 00:00	1.68520	-5.82	0.00	-0.18	46.77
1.06720	1.05140	1.07300	2009.11.04 01:30	1.06796	-34.78	0.00	0.00	263.31
1.51082	1.52750	1.50550	2009.11.04 16:45	1.51067	-22.54	0.00	-0.98	33.91
1.06370	1.08040	1.05890	2009.11.04 22:04	1.06256	-38.54	0.00	0.00	439.88
1.68190	1.66620	1.68670	2009.11.05 09:52	1.68227	-5.88	0.00	0.11	21.79
0.89805	0.91370	0.89400	2009.11.05 00:00	0.89400	0.00	0.00	0.00	51.66
1.51003	1.52630	1.50450	2009.11.04 23:09	1.50952	-32.67	0.00	-4.31	165.77
1.50951	1.49360	1.51550	2009.11.04 23:18	1.50999	-32.34	0.00	0.00	156.03
1.06605	1.08290	1.06210	2009.11.06 01:00	1.06520	-42.30	0.00	-0.38	359.09
1.68600	1.70240	1.68170	2009.11.05 22:56	1.68510	-6.93	0.00	0.00	61.98
1.51149	1.49550	1.51550	2009.11.06 01:39	1.51199	-29.70	0.00	0.56	147.53
1.68510	1.66880	1.68980	2009.11.06 02:00	1.68580	-5.88	0.00	0.04	41.31
1.68870	1.70470	1.68380	2009.11.10 06:08	1.68820	-8.00	0.00	-0.25	39.67

На сайте разработчик многообещающе вопрошает нас: «Вы хотите узнать секрет 100% автоматического робота, приносящего 50 пипсов прибыли каждый день в полностью автоматическом режиме?»

Естественно, мы отвечаем на этот вопрос положительно, тем более что на сайте нас ждет оригинальное и весьма приятное предложение - скачать советник бесплатно. Конечно же, мы не откажем себе в этом удовольствии!

Регистрируемся, пишем свой e-mail и оказываемся в так называемой «зоне скачивания»:

Magic Forex Bot Download Area

Dear Trader,

Thank you for your interest the Magic Forex Bot.

И вот советник у нас. В архиве находим:

- * сам советник (**magicforexbot.ex4**)
- * инструкцию в формате .pdf (**forexmagic.pdf**)

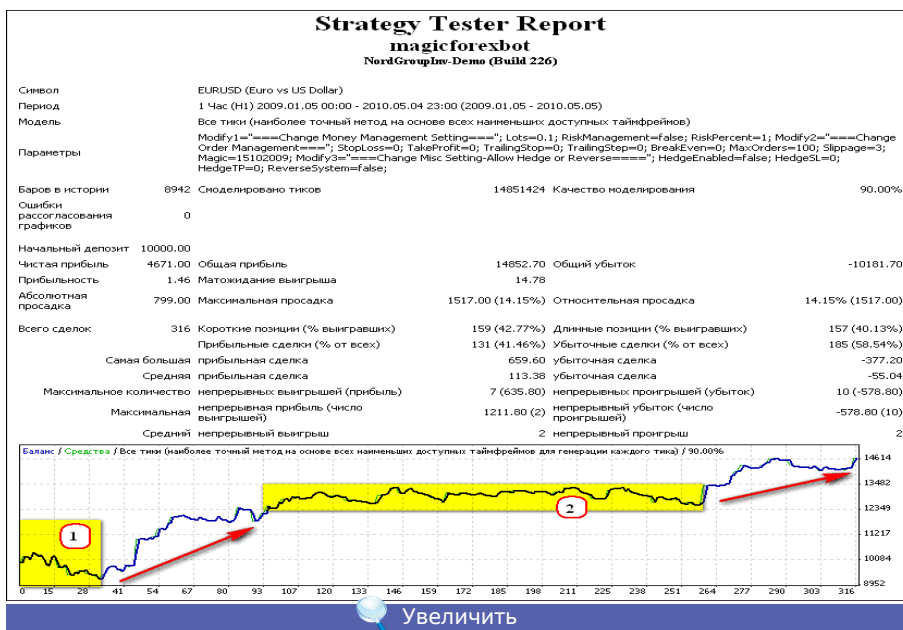
Кроме информации о том, как установить советник в терминал, в инструкции больше нет ничего интересного. Описание параметров советника отсутствует – тут сложно чего-то требовать, так как советник скачан бесплатно. Каких-либо ограничений по количеству или типу счетов в советнике не обнаружено – у нас он заработал без проблем.

Давайте начнем разбираться!

Переменные советника:

Переменная	Значение	Описание
Lots	0.1	Лот для торговли, при отключенном RiskManagement
RiskManagement	false	Торговля RiskPercent от депозита, при true
RiskPercent	1	Процент от депозита
StopLoss	0	Уровень стоп-лосса
TakeProfit	0	Уровень тейк-профита
TrailingStop	0	Уровень трейлинга
TrailingStep	0	Шаг трейлинга
BreakEven	0	Перевод сделки в безубыток при достижении заданного количества пипсов
MaxOrders	100	Максимально возможное количество ордеров
Slippage	3	Уровень проскальзывания для открытия/закрытия позиций
Magic	15102009	Уникальный номер. Необходим для правильного определения советником «своих» ордеров, при торговле несколькими советниками
HedgeEnabled	false	Активация режима хэджирования
HedgeSL	0	Уровень стоп-лосса для режима хэджирования
HedgeTP	0	Уровень тейк-профита для режима хэджирования
ReverseSystem	false	Активация реверсной системы торговли

Перейдем к тестам. Посмотрим, как поведет себя советник в период с января 2010 г. по май 2010 г.:

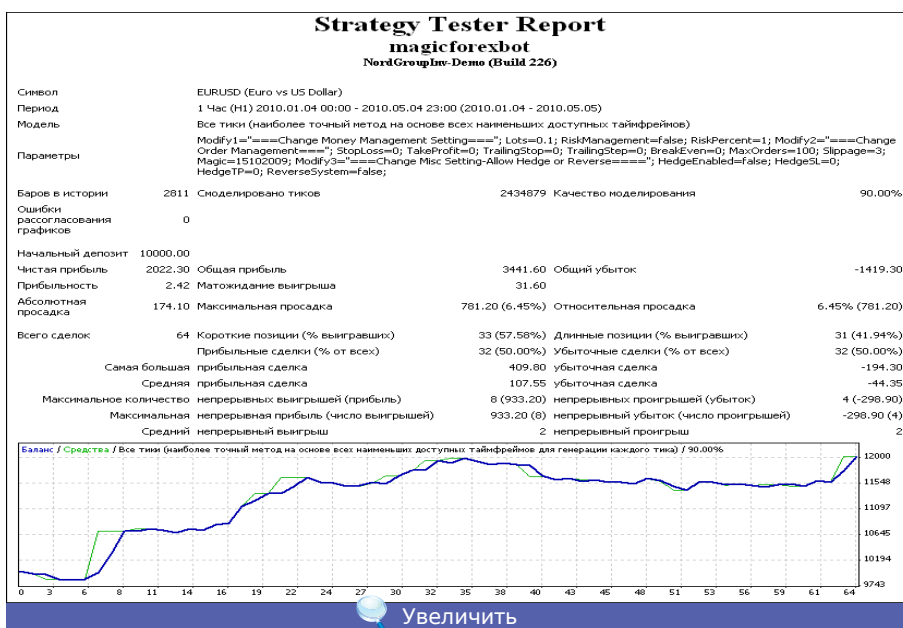


В первый промежуток, отмеченный на графике (5 января 2009 г. – 19 февраля 2009 г.) советник больше месяца торгует в минус. Затем идет непродолжительный рост, и начинается затяжное «плавание» баланса в боковом коридоре – советник не сливает, но и не получает прибыль. Продолжается это с 4 июня 2009 г. по январь 2010 г., из чего можно сделать вывод, что советник оптимизирован на период с начала 2010 г.

Хотим также отметить, что советник, несмотря на 0 в настройках уровней профита и лосса, кроет позиции по внутреннему алгоритму:

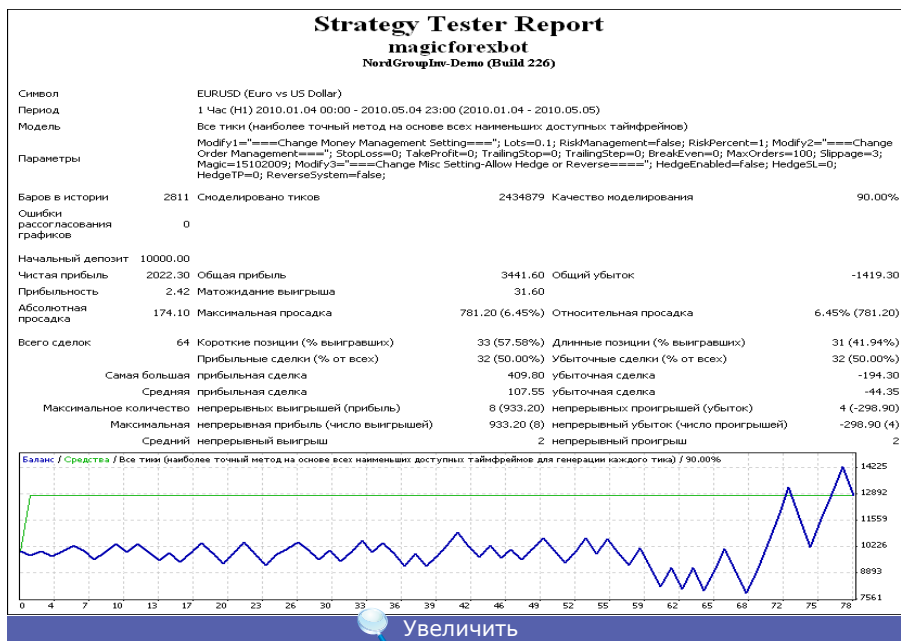
№	Время	Тип	Ордер	Объем	Цена	S / L	T / P	Прибыль	Баланс
5	2010.01.13 08:00	buy	4	0.10	1.45048				
6	2010.01.13 08:00	close	3	0.10	1.45048			-16.40	9950.00
7	2010.01.13 08:00	close	2	0.10	1.45048			-82.30	9867.70
8	2010.01.14 03:00	buy	5	0.10	1.4538				
9	2010.01.14 10:00	sell	6	0.10	1.45214				
10	2010.01.14 10:00	close	5	0.10	1.45214			-16.60	9851.10
11	2010.01.14 10:00	close	4	0.10	1.45214			17.80	9868.90
12	2010.01.15 03:00	sell	7	0.10	1.44384				
13	2010.01.20 03:00	sell	8	0.10	1.42143				
14	2010.01.20 23:00	buy	9	0.10	1.41072				
15	2010.01.20 23:00	close	8	0.10	1.41072			107.10	9976.00

Проведем теперь тест советника с января 2010 г.:



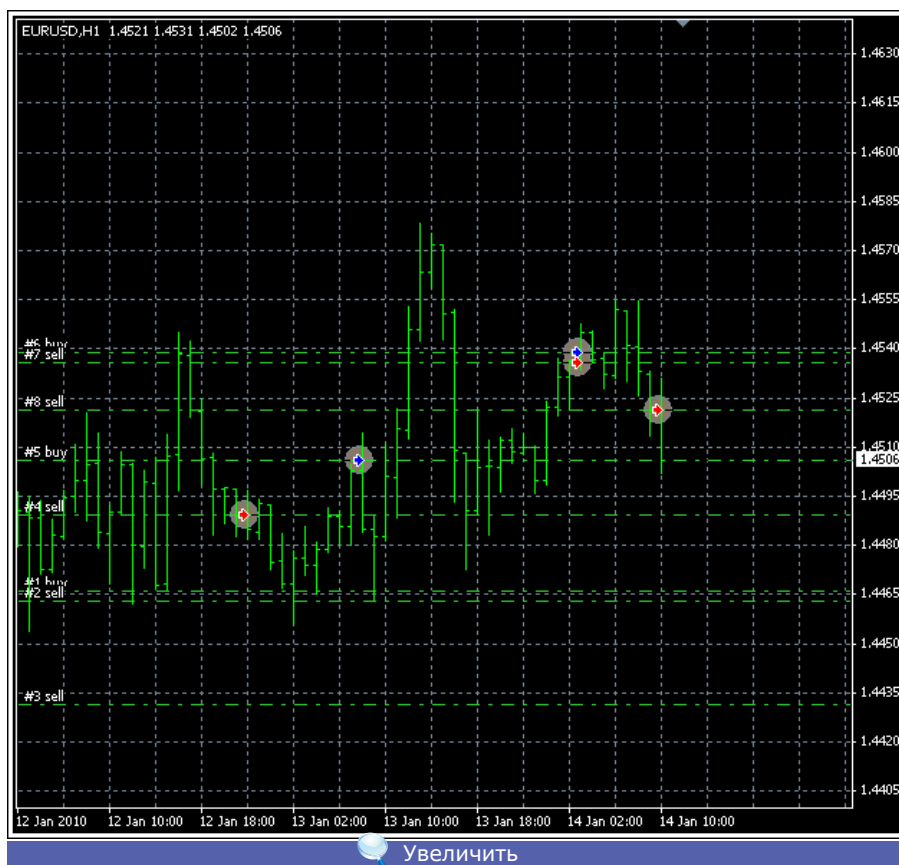
Мы наблюдаем неспешный рост – советник заработал 2022 пипса приблизительно за 86 торговых дней, что в среднем составляет 23 пипса в день. Это так меньше обещанных 50-ти пипсов более чем в два раза.

Посмотрим теперь на торговлю советника в режиме «**HedgeEnabled**» = true:



В данном режиме советник открывает множественные сделки, как на buy, так и на sell одновременно (имейте в виду, что брокер должен поддерживать данный режим торговли). Количество сделок ограничено переменной «**MaxOrders**», которая по умолчанию равна 100. Если тестировать советник в визуальном режиме, то видно, что часто советник имеет неплохую прибыль, но не кроет ее и, спустя некоторое время, уже «висит» в минусах. Закрытие сделок в режиме «**HedgeEnabled**» = true также происходит по внутреннему алгоритму, который явно можно оптимизировать для более профитной торговли.

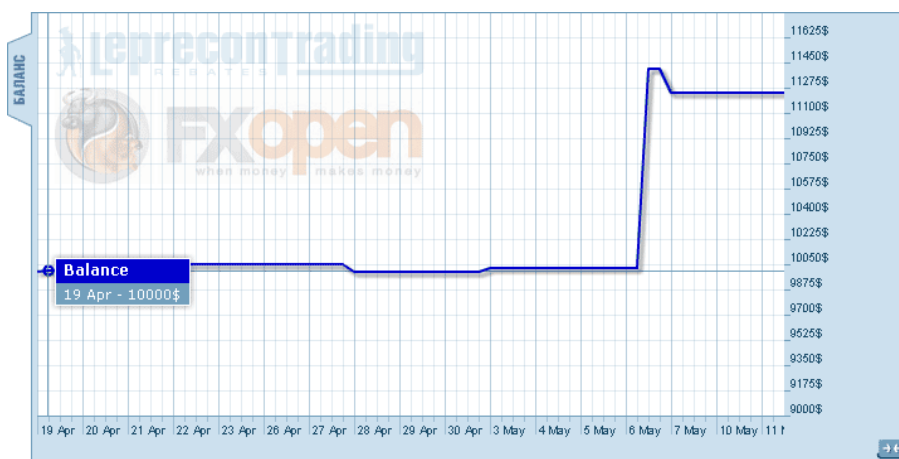




Настало время обратиться к нашей Лаборатории, где советник тестируется с 19 апреля 2010 г. <http://ealab.ru/ea.php?id=141>

За 22 дня мониторинга советник заработал 822 пипса прибыли и увеличил депозит на 12%. Средняя профитность составила 37 пипсов в день.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	Magic Forex Bot	822	11,231.50	16,198.30	22 дней



Пока дела у советника идут неплохо. Заявленной прибыли 50 пипсов в день он, конечно, не показывает и долгое время вообще топтался на месте, но, тем не менее, результат на текущий момент положительный.

Плюсы советника:

- бесплатный;
- простота настройки;

- несколько режимов работы;

Минусы советника:

- большая вероятность подгонки советника под историю;
- советник не показывает обещанного результата;
- отсутствие описания переменных в документации к советнику (возможно, это проблема только бесплатной версии).

Выводы:

Использовать советник на реальном счете рекомендуется только после продолжительного форвард-теста, чтобы убедиться в отсутствии подгонки под историю. Режим «**HedgeEnabled**» продуман не до конца – создается впечатление, что разработчики добавили этот режим, но сами его отключили, чтобы в следующих версиях провести дополнительную доработку и оптимизацию данного режима.

Приглашаем Вас продолжить наблюдение за советником в нашей Лаборатории
<http://ealab.ru/ea.php?id=141>

Удачи и профитов! ■





FXRANGEBREAKER

«FxRangeBreaker» - советник, работающий на 3-х парах: GBP/USD, GBP/JPY, GBP/CHF.

Сайт: <http://www.fxrangebreaker.com>

Платформа: MetaTrader 4

Стоимость лицензии: 497\$

Размер дистрибутива: 1156 кБ

Торгуемые пары: GBP/USD, GBP/JPY, GBP/CHF

Рабочий ТФ: H1, H4

Версия: 1.0

Начало мониторинга в Лаборатории:

5 апреля 2010 г. <http://ealab.ru/ea.php?id=134>

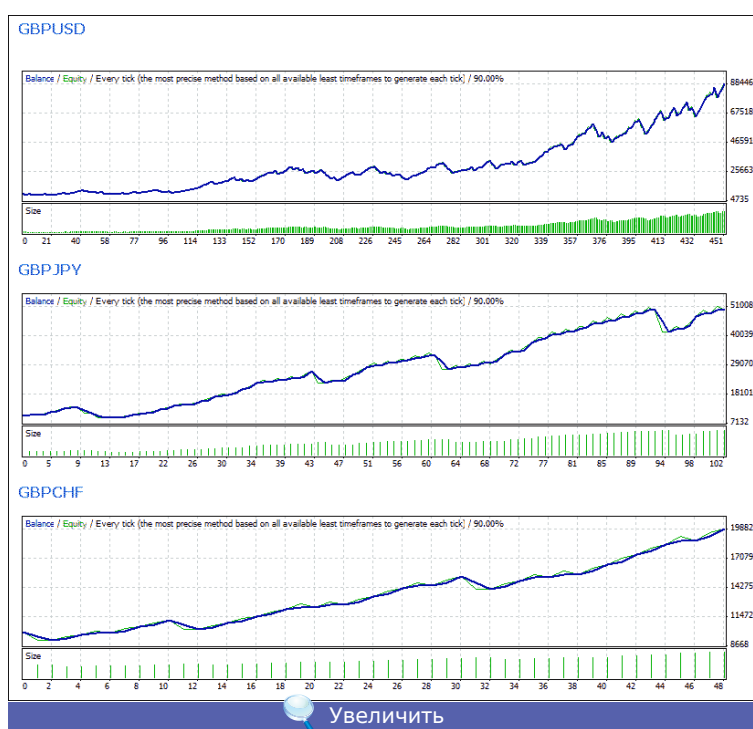
Цитата от разработчика:

«Советник использует простую и эффективную пробойную стратегию».

Наряду с основными преимуществами продукта, которые мы привыкли видеть в рекламном сопровождении к предлагаемым на рынке советникам, в данном случае мы видим несколько дополнительных довольно оригинальных заявлений:

- Нет фальшивых обещаний, пропаганды или обмана;
- Не требуется опыт торговли;
- Нет блестящей и мигающей рекламы на сайте;
- Не использованы ролики со специально приглашенными актерами;
- Возврат денег в течение 30 дней, если не устроит качество;
- Небольшой стоп-лосс (40 пипсов);
- Обновления под текущие рыночные условия;
- Свободные обновления в течение всей жизни;
- Удвоение депозита каждые 6 месяцев;
- Полностью совместим с ECN и NFA.

Далее приводятся симпатичные графики роста баланса по всем торгуемым советником парам:

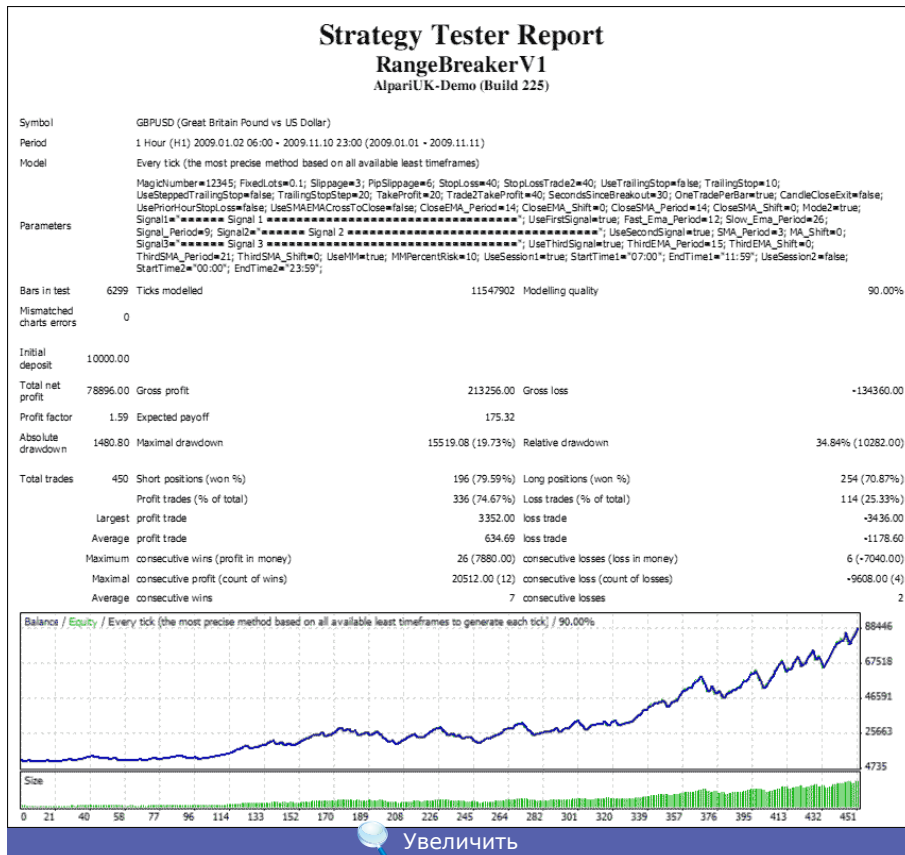


Выглядит неплохо, хотя по этим графикам непонятно, за какой отрезок времени проведены тесты.

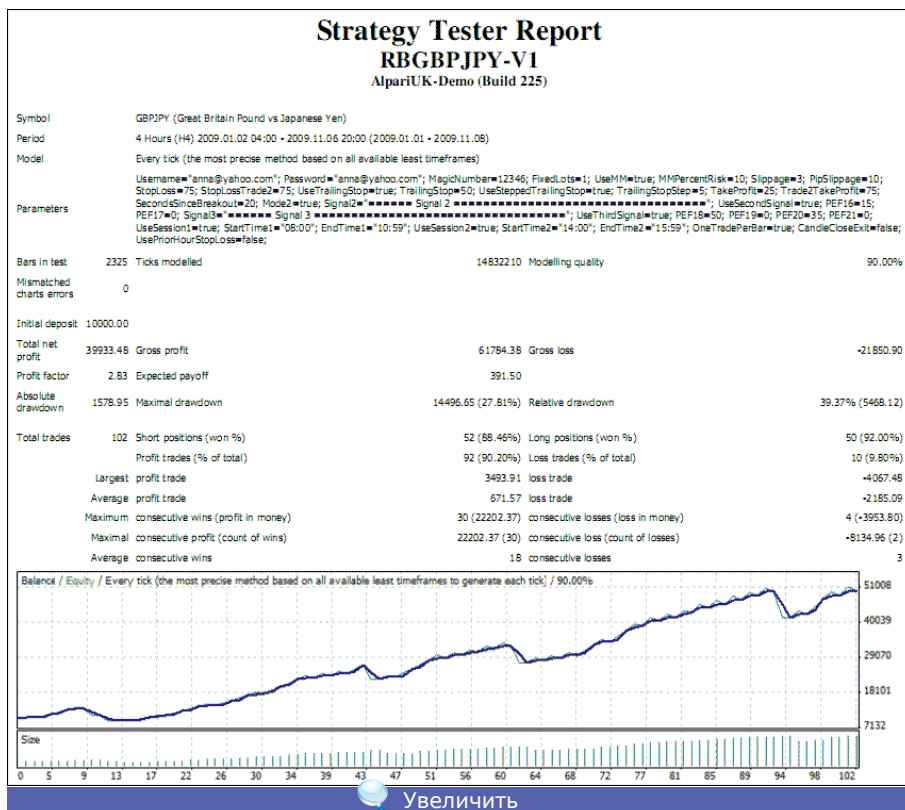
Performance

Что ж, идем дальше и в разделе «Performance» мы находим ответ на наш вопрос.

GBP/USD (2 января 2009 г. – 10 ноября 2009 г.):

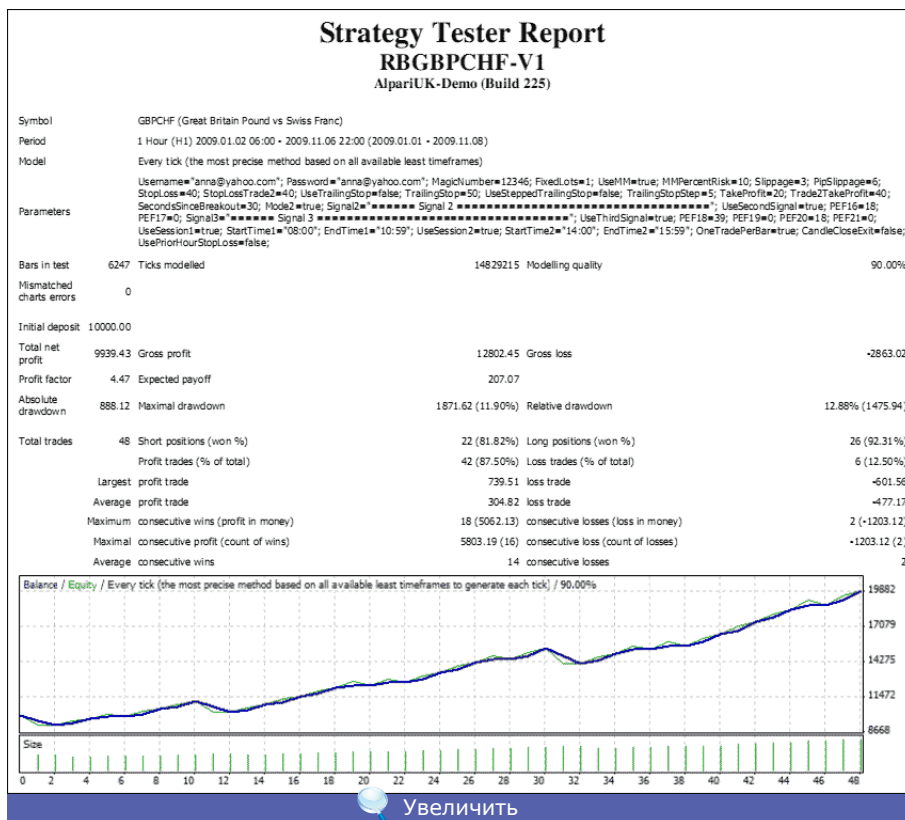


GBP/JPY (2 января 2009 г. – 6 ноября 2009 г.):



ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

GBP/CHF (2 января 2009 г. – 6 ноября 2009 г.):



Видимо, ребята давно не обновляли свой сайт – все тесты заканчиваются ноябрем 2009 г.

В общем-то, это все, что можно посмотреть на сайте.

Хотя, пожалуй, давайте еще заглянем в раздел FAQ – один из вопросов стоит того, чтобы о нем упомянуть. Вопрос касается возможности проведения бэктестов. Разработчики отвечают, что провести бэктесты вполне реально – нужно подзагрузить исторические котировки и ввести свой логин и пароль в соответствующие поля в советнике. Однако разработчики не рекомендуют проводить тестирование глубиной более чем 6 месяцев, так как условия на рынке меняются, и, в таком случае, разработчик обещает прислать обновленные настройки советника.

Откровенно говоря, такая постановка вопроса несколько напрягает: получается, что пользователь зависит от какого-то «дяди», который должен заметить изменение рыночной тенденции, провести переоптимизацию и прислать пользователю новые настройки... А что, если он заметит изменения слишком поздно? или не заметит их вообще? или просто забудет, не успеет прислать?.. Вопрос, конечно, риторический. Но, судя по промежутку 6 месяцев, указанному разработчиком, можно сделать предварительный вывод о том, что именно на таком временном отрезке проводится оптимизация советника, либо необходима оптимизация советника минимум раз в полгода, при этом не исключено, что советник просто подогнан под историю.

Чтобы говорить об этом более определенно, нужно приобрести советник. Поэтому мы идем в раздел «Buy Now» и, заплатив довольно круглую сумму \$497 USD через систему Plimus, покупаем советник для проведения дальнейших экспериментов.

Read this [Risk Disclaimer](#) before you buy

Click here to buy RangeBreaker safely through plimus

Price : \$497.00

Итак, в комплект входит:

- исполняемый файл-установщик FxRangebreaker-installer.exe
- документация RangeBreaker.pdf

Документация простая – ничего лишнего. Описаны переменные советника и основной принцип работы советника – пробойная тактика.

Запускаем установщик, указываем путь к терминалам, в которые планируем производить установку советника.

После распаковки видим 4 советника (каждый настроен на свою пару и свой рабочий ТФ) и одну общую DLL.

Рассмотрим переменные советника:

Username, Password – логин и пароль пользователя лицензионной версии;

FixedLots – лот для торговли при отключенном UseMM;

UseMM – активация режима встроенного MM;

MMPercentRisk – риск в процентах от депозита при UseMM = true;

Slippage – проскальзывание в пипсах для открытия/закрытия сделок;

PipSlippage – показывает, на сколько пипсов должен произойти пробой для открытия сделки.

В советнике используется два встроенных индикатора, поэтому следующие переменные относятся к ним:

StopLoss, StopLossTrade2 – лосс в пипсах для обеих сделок;

TakeProfit, Trade2TakeProfit – профит в пипсах для обеих сделок;

UseTrailingStop – режим обычного трейлинга;

UseSteppedTrailingStop – активация режима шагового трейлинга;

SecondsSinceBreakout – устанавливает количество секунд после пробоя для входа в сделку;

UseSecondSignal, UseThirdSignal – активация дополнительных фильтров (Второй фильтр подразумевает торговлю в направлении, заданном MA; Третий – пересечение MA);

UseSession1, UseSession2 – задают два торговых промежутка;

StartTime1, EndTime1, StartTime2, EndTime2 – переменные для задания двух торговых промежутков;

OneTradePerBar – при true открытие только одной сделки за 1 бар;

CandleCloseExit – выход только после закрытия свечи;

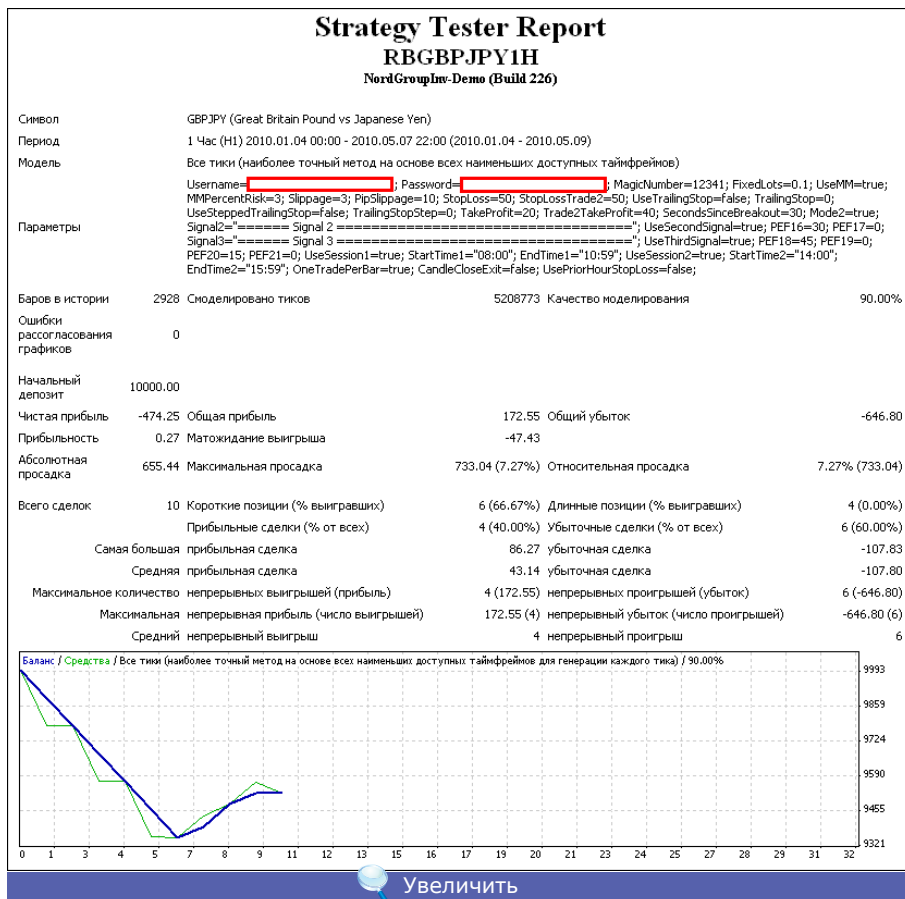
UsePriorHourStopLoss – установка стоп-лосса, в зависимости от экстремумов уже закрытой свечи.

Перейдем теперь к тестированию советника. Так как у разработчика период тестирования заканчивается концом 2009 г., мы будем смотреть, как ведет себя советник на исторических данных 2010 г.

GBP/USD H1 (4 января 2010 г. – 7 мая 2010 г.):



GBP/JPY H1 (4 января 2010 г. – 7 мая 2010 г.):

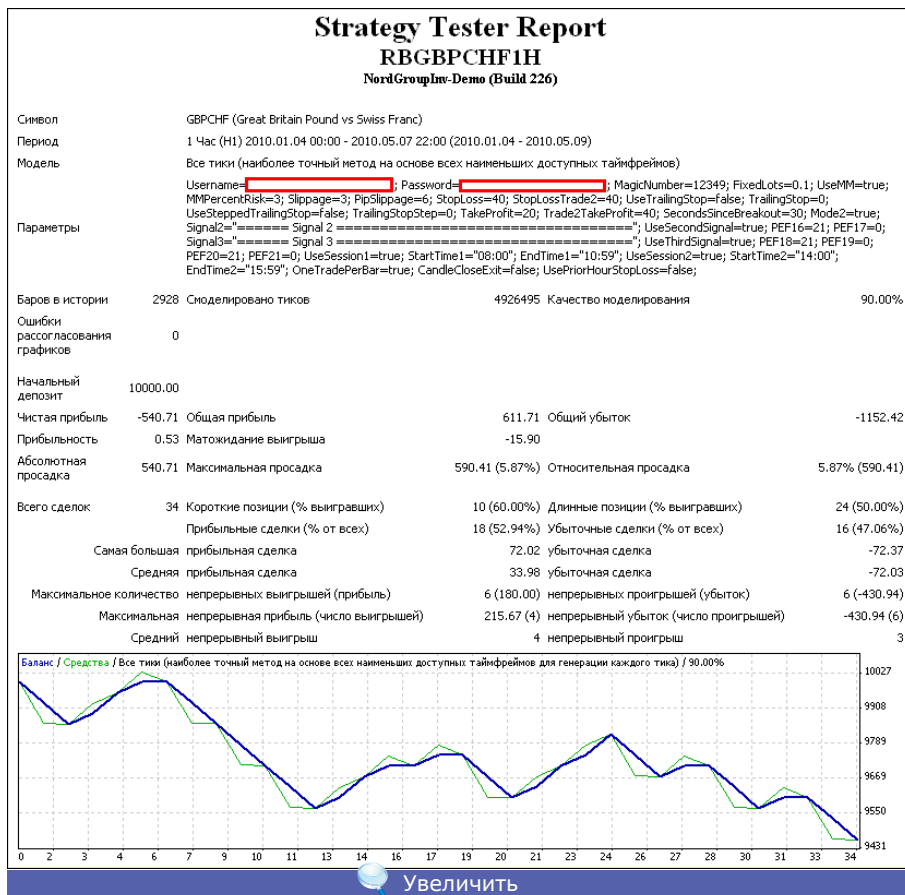


ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

GBP/JPY H4 (4 января 2010 г. – 7 мая 2010 г.):



GBP/CHF H1 (4 января 2010 г. – 7 мая 2010 г.):




ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

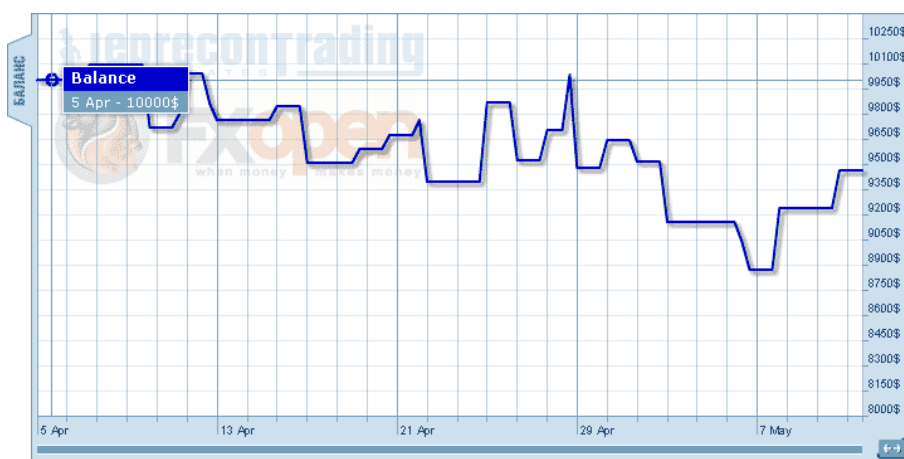
Вот такие, прямо скажем, неутешительные результаты тестирования. Только по паре GBP/JPY H4 мы видели рост в начале тестирования, который, в итоге, довольно резко прервался чередой минусов, и советник закончил тест с нулевым результатом. Все же остальные пары ушли в минус.

Похоже, наступил как раз тот момент, о котором мы говорили ранее – советник уже перестал давать прибыль, а новых настроек от разработчика так и нет.

Перейдем в Лабораторию <http://ealab.ru/ea.php?id=134>

За 37 дней мониторинга убыток составил 123 пипса.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	FxRangeBreaker	-123	9,456.51	14,456.50	37 дней



Дальнейшие комментарии, пожалуй, излишни...

Выводы:

Советник, как минимум, нуждается в дополнительной оптимизации. Ждать рекомендаций автора или пробовать оптимизировать самому – каждый должен решать для себя сам. Тот факт, что трендовый советник нуждается в достаточно частой оптимизации, означает, что вероятность подгона под историю у данного советника максимально высока, так как сделок за оптимизируемый период немного, и о репрезентативности результатов говорить не приходится. Если вдруг кто-то захочет использовать советник на своем счете, то проведение форвард-тестов после оптимизации является обязательным условием, иначе Вы рискуете поставить свой депозит под угрозу слива.

Плюсы советника:

- трендовая стратегия, не критичная к котировкам;
- торговля на 3-х парах;

Минусы советника:

- советник подстроен под историю и требует дополнительной оптимизации или модернизации;
- зависимость от настроек автора, обещающего обновлять данные настройки при смене рыночной тенденции;
- высокая стоимость лицензии.

Приглашаем Вас продолжить наблюдение за советником в нашей Лаборатории <http://ealab.ru/ea.php?id=134>

Удачи и профитов! ■

МОНИТОРИНГ СОВЕТНИКОВ

В каждом номере нашего журнала мы делаем обзоры советников и торговых систем - рассматриваем, как советник ведет себя при тестировании на исторических данных, и ставим советник тестироваться на реальный счет в нашу Лабораторию <http://ealab.ru>

Часто бывает, что при выходе обзора советник еще не успел достаточное время проработать на реальном счете, и интересно было бы взглянуть на результат его торговли через несколько месяцев. Или, в случае если советник оказался «сливным», убедиться, что не стоит тратить на него свое внимание и деньги.

Именно для этого была создана наша новая рубрика «Мониторинг советников». В ней мы сможем вернуться к нашим обзорам и посмотреть, что произошло с советником или торговой системой спустя некоторое время.

«FXBROKERBUSTER»

(см. «Leprecon Review» №3 <http://forum.leprecontrading.com/download/file.php?id=1157&sid=63b4f704523cbee3899a7c90a3da56bc>)

Автор: Martin Bloomington
Сайт: <http://www.fxbrokerbuster.com>
Платформа: MetaTrader 4
Стоимость лицензии: 199.99\$
Торгуемые пары: EUR/USD
Рабочий ТФ: M5
Рекомендуемый депозит: 2000\$



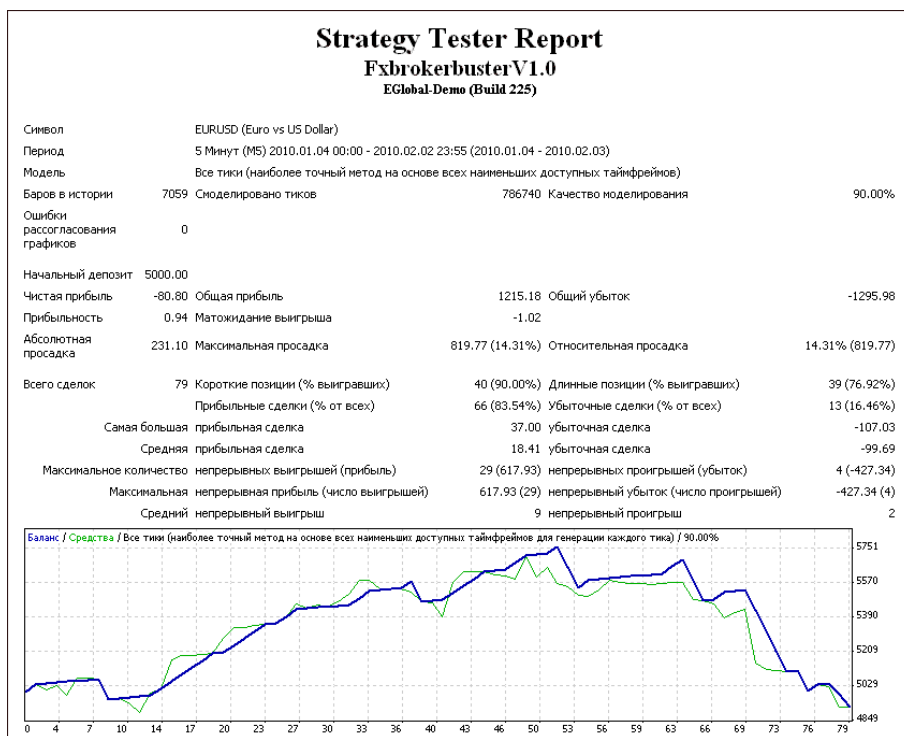
Вернемся к материалам, опубликованным в «Leprecon Review» №3, и посмотрим, как идет торговля советника в настоящий момент.

Итак, вот результат теста, который получился у нас с постоянным лотом 0,1 на том же временном отрезке, который указан на сайте:



МОНИТОРИНГ СОВЕТНИКОВ

Основной рост начался приблизительно с июня 2009 года. До этого процесс роста баланса был не такой крутой и местами напоминал топтание на месте. Из этого можно сделать вывод, что советник мог быть оптимизирован на работу именно с июня 2009 года. Впрочем, до этой даты советник не слил начальный депозит, поэтому перейдем к следующей проверке – протестируем советник с января 2010 года, чтобы проверить, были ли подогнаны его настройки под историю:



То, чего мы опасались, произошло. Начиная торговлю с января 2010 года, советник в конце тестируемого периода проводит ряд неудачных сделок, что приводит к «сливу» заработанного за начальный промежуток времени плюс небольшой части от начального депозита. Вывод - советник подогнан под определенный временной интервал.

И вот - настоящий момент... Лаборатория.

Советник тестируется в нашей Лаборатории 146 дней.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Закиты	Общее время теста
	FXBrokerBuster	-1203	5,736.93	5,736.92	146 дней

Просадка по депозиту составила более 50%. Потери в пипсах составляют -1203.



Вывод: К сожалению, вынуждены констатировать, что первоначальный вывод о подгонке советника под исторические данные подтвердился. На форвард-тесте советник показал свою несостоятельность, и, хотя депозит еще не слит до конца, тем не менее, просадка составляет 50%, и график баланса стабильно уменьшается без видимых намеков на улучшение ситуации в будущем.

«FXBROKERBUSTER»



ШКОЛА MQL4 (ПРОДОЛЖЕНИЕ)



Кирилл Еременко

Программист со стажем работы на рынке FOREX более трёх лет. Имеет техническое образование. Является автором многих механических торговых систем. Технический аналитик и ведущий MQL4-разработчик компании Forex4You. Ведущий очных курсов по программированию на языке MQL4.

Урок 21

ФУНКЦИИ ДЛЯ РАБОТЫ С МАССИВАМИ

В предыдущем уроке мы поговорили о массивах и рассмотрели все своеобразие массивов в целом и в MQL4 в частности. Но в MQL4 есть набор специальных функций для работы с массивами.

Сегодня мы рассмотрим все эти функции одну за другой. Всего их 15 штук.

- [ArrayBsearch](#)
- [ArrayCopy](#)
- [ArrayCopyRates](#)
- [ArrayCopySeries](#)
- [ArrayDimension](#)
- [ArrayGetAsSeries](#)
- [ArrayInitialize](#)
- [ArrayIsSeries](#)
- [ArrayMaximum](#)
- [ArrayMinimum](#)
- [ArrayRange](#)
- [ArrayResize](#)
- [ArraySetAsSeries](#)
- [ArraySize](#)
- [ArraySort](#)

1 - ArrayBsearch()

Синтаксис:

```
int ArrayBsearch( double array[], double value, int count=WHOLE_ARRAY, int start=0, int direction=MODE_ASCEND)
```

Описание:

Возвращает индекс первого найденного элемента в первом измерении массива.

Если элемент с указанным значением в массиве отсутствует, функция вернет индекс ближайшего элемента (по значению).

Функция не может применяться к массивам строк и таймсериям (исключение составляет таймсерия времени открытия бара).

Замечание: двоичный поиск обрабатывает только сортированные массивы. Для сортировки числового массива используется функция `ArraySort()`.

Параметры:

`array[]` - Числовой массив для поиска.

`value` - Значение для поиска.

`count` - Количество элементов для поиска. По умолчанию ищется в целом массиве.

`start` - Начальный индекс для поиска. По умолчанию поиск начинается с первого элемента.

`direction` - Направление поиска. Может быть любой из следующих величин:

`MODE_ASCEND` поиск в направлении возрастания;

`MODE_DESCEND` поиск в направлении убывания.

2 - `ArrayCopy()`

Синтаксис:

```
int ArrayCopy( object&dest[], object source[], int start_dest=0, int start_source=0, int count=WHOLE_ARRAY)
```

Описание:

Копирует один массив в другой. Массивы должны иметь одинаковый тип. Массивы типа `double[]`, `int[]`, `datetime[]`, `color[]`, и `bool[]` можно копировать как массивы одного типа.

Возвращает количество скопированных элементов.

Параметры:

`dest[]` - Массив-приемник.

`source[]` - Массив-источник.

`start_dest` - Начальный индекс для приемного массива. По умолчанию стартовый индекс - 0.

`start_source` - Начальный индекс для исходного массива. По умолчанию стартовый индекс - 0.

`count` - Количество элементов, которые нужно скопировать. По умолчанию весь массив (`WHOLE_ARRAY`).

3 - `ArrayCopyRates()`

Синтаксис:

```
int ArrayCopyRates( double&dest_array[], string symbol=NULL, int timeframe=0)
```

Описание:

Копирует в двумерный массив вида `RateInfo[][6]` данные баров текущего графика и возвращает количество скопированных баров либо -1 в случае неудачи. Первое измерение содержит количество баров. Второе измерение имеет 6 элементов со значениями:

0 - время (time),

1 - цена открытия (open),

2 - наименьшая цена (low),

3 - наивысшая цена (high),

4 - цена закрытия (close),

5 - объём (volume).

Если копируются данные "чужого" инструмента и/или тайм-фрейма, то возможна ситуация отсутствия требуемых данных. В этом случае в переменную `last_error` будет помещена ошибка `ERR_HISTORY_WILL_UPDATED` (4066 - запрошенные исторические данные в состоянии обновления), и необходимо через некоторое время повторить попытку копирования.

Замечание: обычно массив используется, чтобы передать данные в DLL функцию. Реального распределения памяти под массив данных и копирования не происходит. При обращении к такому массиву производится перенаправление доступа.

Параметры:

`dest_array[]` - Ссылка на двумерный массив.

`symbol` - Наименование инструмента (символ валютной пары).

`timeframe` - Период. Может быть любым значением из перечисленных периодов.

4 - `ArrayCopySeries()`

Синтаксис:

```
int ArrayCopySeries( double&array[], int series_index, string symbol=NULL, int timeframe=0)
```

Описание:

Копирует массив-таймсерию в пользовательский массив и возвращает количество скопированных элементов.

Реального распределения памяти под массив данных и копирования не происходит. При обращении к такому массиву производится перенаправление доступа. Исключение составляют массивы, назначенные в качестве индексных в пользовательских индикаторах. В этом случае производится реальное копирование данных.

Если копируются данные "чужого" инструмента и/или тайм-фрейма, то возможна ситуация отсутствия требуемых данных. В этом случае в переменную `last_error` будет помещена ошибка `ERR_HISTORY_WILL_UPDATED` (4066 - запрошенные исторические данные в состоянии обновления), и необходимо через некоторое время повторить попытку копирования.

Замечание: если `series_index` - `MODE_TIME`, то передаваемый в функцию массив должен иметь тип `datetime[]`.

Параметры:

`array[]` - Ссылка на одномерный числовой массив.

`series_index` - Идентификатор массива-таймсерии. Должен быть одним из перечисленных идентификаторов таймсерий.

`symbol` - Наименование инструмента (символ валютной пары).

`timeframe` - Период графика (тайм-фрейм). Может быть любым значением из перечисленных периодов.

5 - `ArrayDimension()`

Синтаксис:

```
int ArrayDimension( object array[])
```

Описание:

Возвращает ранг многомерного массива.

Параметры:

`array[]` - Массив, для которого будет возвращен ранг.

6 - ArrayGetAsSeries()

Синтаксис:

```
bool ArrayGetAsSeries( object array[])
```

Описание:

Возвращается TRUE, если массив организован как таймсерия (элементы массива индексируются от последнего к первому), иначе возвращается FALSE.

Параметры:

array[] - Проверяемый массив.

7 - ArrayInitialize()

Синтаксис:

```
int ArrayInitialize( double&array[], double value)
```

Описание:

Устанавливает все элементы числового массива в одну величину. Возвращает количество инициализированных элементов.

Замечание: не рекомендуется инициализировать индексные буферы в функции init() пользовательских индикаторов, так как они инициализируются автоматически "пустым значением" при распределении и перераспределении буферов.

Параметры:

array[] - Числовой массив, который нужно инициализировать.

value - Новая величина, которую нужно установить.

8 - ArrayIsSeries()

Синтаксис:

```
bool ArrayIsSeries( object array[])
```

Описание:

Возвращается TRUE, если проверяемый массив является массивом-таймсерией (Time[],Open[],Close[],High[],Low[] или Volume[]), иначе возвращается FALSE.

Параметры:

array[] - Проверяемый массив

9 - ArrayMaximum()

Синтаксис:

```
int ArrayMaximum( double array[], int count=WHOLE_ARRAY, int start=0)
```

Описание:

Поиск элемента с максимальным значением. Функция возвращает позицию максимального элемента в массиве.

Параметры:

array[] - Числовой массив, в котором производится поиск.

count - Количество элементов для поиска.

start - Начальный индекс для поиска.

10 - ArrayMinimum()

Синтаксис:

```
int ArrayMinimum( double array[], int count=WHOLE_ARRAY, int start=0)
```

Описание:

Поиск элемента с минимальным значением. Функция возвращает позицию минимального элемента в массиве.

Параметры:

array[] - Числовой массив, в котором производится поиск.

count - Количество элементов для поиска.

start - Начальный индекс для поиска.

11 - ArrayRange()

Синтаксис:

```
int ArrayRange( object array[], int range_index)
```

Описание:

Возвращает число элементов в указанном измерении массива. Поскольку индексы начинаются с нуля, размер измерения на 1 больше, чем самый большой индекс.

Параметры:

array[] - Проверяемый массив.

range_index - Индекс измерения.

12 - ArrayResize()

Синтаксис:

```
int ArrayResize( object&array[], int new_size)
```

Описание:

Устанавливает новый размер в первом измерении массива. При успешном выполнении функция возвращает количество всех элементов, содержащихся в массиве после изменения размера, в противном случае возвращает -1, и массив не меняет размеры.

Замечание: массив, объявленный на локальном уровне в какой-либо функции, у которого был изменен размер, останется неизменным после завершения работы функции. При повторном вызове функции такой массив будет иметь размер, отличный от объявленного.

Параметры:

array[] - Массив для изменения размеров.

new_size - Новый размер для первого измерения.

13 - ArraySetAsSeries()

Синтаксис:

```
bool ArraySetAsSeries( double&array[], bool set)
```

Описание:

Устанавливает направление индексирования в массиве. Значение параметра set TRUE устанавливает направление индексирования в обратном порядке, то есть последний элемент имеет нулевой индекс. Значение FALSE устанавливает нормальное направление индексирования. Функция возвращает предыдущее состояние.

Параметры:

array[] - Числовой массив для установки.
set - Направление индексирования массива.

14 - ArraySize()**Синтаксис:**

```
int ArraySize( object array[])
```

Описание:

Возвращает количество элементов массива. Для одномерного массива значение, возвращаемое функцией ArraySize, равно значению ArrayRange(array,0).

Параметры:

array[] - Массив любого типа.

15 - ArraySort()**Синтаксис:**

```
int ArraySort( double&array[], int count=WHOLE_ARRAY, int start=0, int sort_dir=MODE_ASCEND)
```

Описание:

Сортировка числовых массивов по первому измерению. Массивы-таймсерии не могут быть отсортированы.

Параметры:

array[] - Числовой массив для сортировки.
count - Количество элементов для сортировки.
start - Начальный индекс.
sort_dir - Направление сортировки массива. Это может быть любым из следующего величин
MODE_ASCEND - сортировка в порядке возрастания
MODE_DESCEND - сортировка в порядке убывания.

Урок 22

ГЛОБАЛЬНЫЕ ПЕРЕМЕННЫЕ

В этом уроке мы будем изучать глобальные переменные языка MQL4 и набор функций для работы с ними.

Что же такое глобальные переменные?

Глобальные переменные - это специальные переменные, которые хранятся в отдельно выделяемой памяти, благодаря чему они коллективно доступны всем MQL4-программам внутри одного терминала. Также данные в памяти, выделяемой под такие переменные, сохраняются при перезапуске терминала.

- [GlobalVariableCheck](#)
- [GlobalVariableDel](#)
- [GlobalVariableGet](#)
- [GlobalVariableName](#)
- [GlobalVariableSet](#)
- [GlobalVariableSetOnCondition](#)
- [GlobalVariablesDeleteAll](#)
- [GlobalVariablesTotal](#)

В MQL4 Вы используете обыкновенные переменные для временного хранения данных, и они существуют только когда программа работает, а при её деинициализации исчезают. Но глобальные переменные продолжают существовать, когда программа деинициализирована и даже когда Вы выключаете терминал! Терминал способен помнить глобальную переменную в течение четырёх недель с момента последнего обращения к ней.

Насколько полезны глобальные переменные?

Основная задача глобальных переменных - обеспечить внутритерминальную связь между различными МТС.

Пример: Допустим, Вы создали два советника:

Первый работает на дневном графике EURUSD и покупает, когда скользящая средняя за последние 10 дней пересекает скользящую среднюю за последние 80 дней **вверх**.
И продаёт, когда скользящая средняя за последние 10 дней пересекает скользящую среднюю за последние 80 дней **вниз**.

Второй работает на часовом графике EURUSD и покупает, когда скользящая средняя за последние 10 часов пересекает скользящую среднюю за последние 80 часов **вверх**.
И продаёт, когда скользящая средняя за последние 10 часов пересекает скользящую среднюю за последние 80 часов **вниз**.

Вы **не** хотите, чтобы эти два советника принимали конфликтующие решения - Вы **не** хотите, чтобы первый советник продавал EURUSD, в то время как второй советник покупает EURUSD.

При этом ни один из советников не подозревает о действиях другого. Как же им общаться? Они могут общаться посредством записи/чтения в/из **глобальных переменных**. Например, первый советник сможет записывать тип своей операции: BUY или SELL - в глобальную переменную, а второй перед открытием ордера может считывать эту переменную и сравнивать тип ордера, который он намеревается открыть, с тем типом, что хранится в переменной.

Ещё один пример использования глобальных переменных.

Пусть у Вас есть советник, торгующий с одинаковыми настройками на 10 графиках. Чтобы изменить одну какую-то настройку (например, вместо периода 10 поставить период 25), Вам придётся перебрать все 10 графиков и 10 раз изменить эту настройку. Но если советники используют общие глобальные переменные для хранения настроек, то Вам придётся сделать это всего лишь один раз! Лень - двигатель прогресса! 😊

Функции для работы с глобальными переменными.

В языке MQL4 существует 8 функций для работы с глобальными переменными. Вот эти функции:

1 - GlobalVariableCheck()

Синтаксис:

```
bool GlobalVariableCheck( string name)
```

Описание:

Возвращает значение TRUE, если глобальная переменная существует, иначе возвращает FALSE.

Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError().

Параметры:

name - Имя глобальной переменной.

2 - GlobalVariableDel()**Синтаксис:**

```
bool GlobalVariableDel( string name)
```

Описание:

Удаляет глобальную переменную. При успешном удалении функция возвращает TRUE, иначе FALSE. Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError().

Параметры:

name - Имя глобальной переменной.

3 - GlobalVariableGet()**Синтаксис:**

```
double GlobalVariableGet( string name)
```

Описание:

Возвращает значение существующей глобальной переменной или 0 в случае ошибки. Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError().

Параметры:

name - Имя глобальной переменной.

4 - GlobalVariableName()**Синтаксис:**

```
string GlobalVariableName( int index)
```

Описание:

Функция возвращает имя глобальной переменной по порядковому номеру в списке глобальных переменных. Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError().

Параметры:

index - Порядковый номер в списке глобальных переменных. Должен быть большим или равным 0 и меньшим, чем GlobalVariablesTotal().

5 - GlobalVariableSet()**Синтаксис:**

```
datetime GlobalVariableSet( string name, double value)
```

Описание:

Устанавливает новое значение глобальной переменной. Если переменная не существует,

то система создает новую глобальную переменную. При успешном выполнении функция возвращает время последнего доступа, иначе 0. Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError().

Параметры:

name - Имя глобальной переменной.

value - Новое числовое значение.

6 - GlobalVariableSetOnCondition()**Синтаксис:**

```
bool GlobalVariableSetOnCondition( string name, double value, double check_value)
```

Описание:

Устанавливает новое значение существующей глобальной переменной, если текущее значение переменной равно значению третьего параметра check_value. Если переменной не существует, функция сгенерирует ошибку ERR_GLOBAL_VARIABLE_NOT_FOUND (4058) и вернет FALSE. При успешном выполнении функция возвращает TRUE, иначе FALSE. Для того чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию GetLastError(). Если текущее значение глобальной переменной отличается от check_value, функция вернет FALSE.

Функция обеспечивает атомарный доступ к глобальной переменной, поэтому она может быть использована для организации семафора при взаимодействии нескольких одновременно работающих экспертов в пределах одного клиентского терминала.

Параметры:

name - Имя глобальной переменной.

value - Новое значение.

check_value - Значение для проверки текущего значения глобальной переменной.

7 - GlobalVariablesDeleteAll()**Синтаксис:**

```
int GlobalVariablesDeleteAll( string prefix_name=NULL)
```

Описание:

Удаляет глобальные переменные. Если префикс для имени не задан, то удаляются все глобальные переменные. В противном случае удаляются только те переменные, имена которых начинаются на указанный префикс. Функция возвращает количество удаленных переменных.

Параметры:

prefix_name - Префикс имени удаляемых глобальных переменных.

8 - GlobalVariablesTotal()**Синтаксис:**

```
int GlobalVariablesTotal( )
```

Описание:

Функция возвращает общее количество глобальных переменных.

Параметры:

- отсутствуют.

ВАША ПЕРВАЯ DLL (часть 1)

С недавнего времени всё чаще слышу испуганные восклицания трейдеров "У этого советника есть DLL!", "А куда положить DLL?", "Зачем вообще нужны эти DLL?" и т.д. Что объединяет все эти фразы? Правильно! Загадочное и пугающее слово "D-L-L". Я решил написать пару уроков на эту тему. Итак, начнём!

Что же такое DLL?

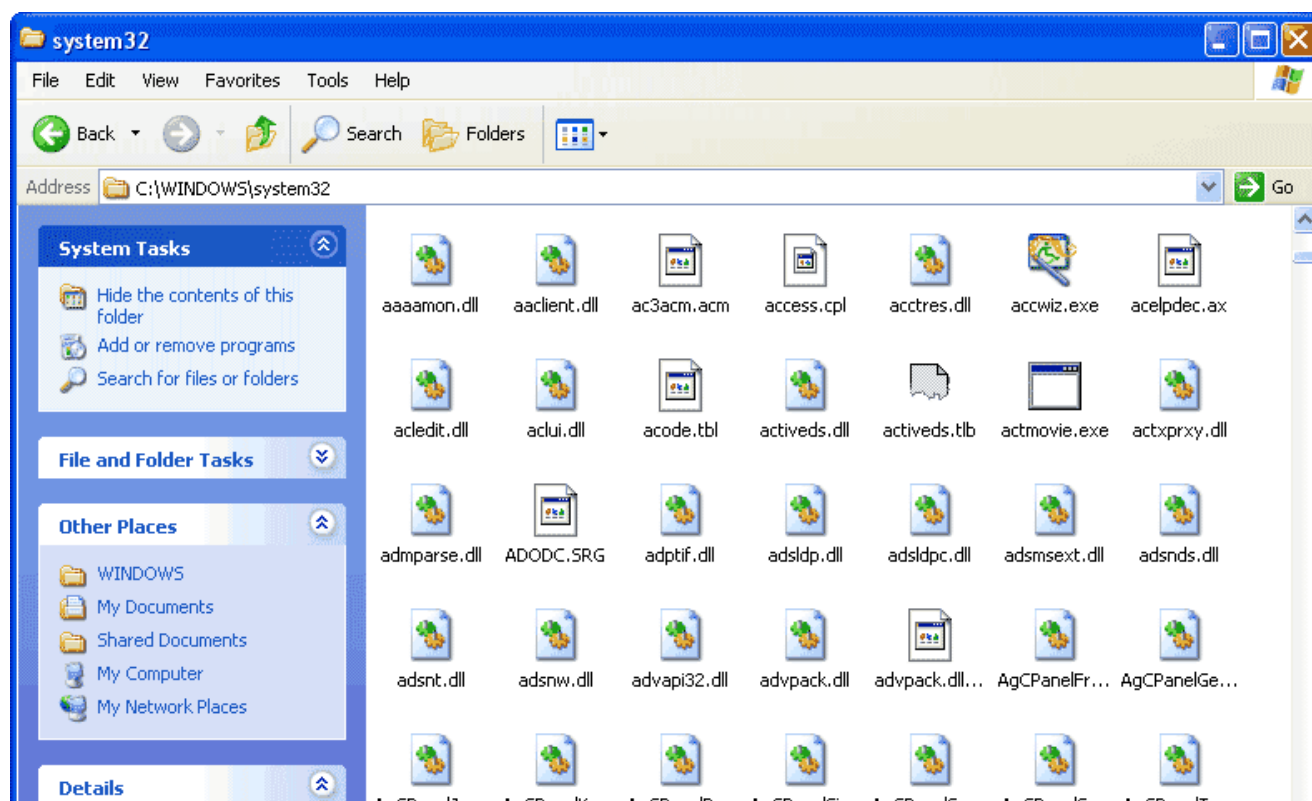
DLL (англ. **Dynamic-link library** — динамически подключаемая библиотека) — понятие операционных систем Microsoft Windows и IBM OS/2; динамическая библиотека, позволяющая многократное применение различными программными приложениями. К DLL относятся также элементы управления ActiveX и драйверы. В мире UNIX аналогичные функции выполняют так называемые shared objects («разделяемые объекты»).

(Wikipedia)

По сути, DLL - это такой же код, с тем лишь отличием, что он не является исполняемым. Вы можете более подробно узнать про историю возникновения DLL, их первоначальное назначение и DLL-hell на википедии: <http://ru.wikipedia.org/wiki/DLL>

Если объяснять «на пальцах», то DLL - это вспомогательные блоки, в которые выносятся части кода, используемые приложениями. DLL программируются и компилируются, а затем линкуются приложениями, что позволяет последним получать доступ к содержащимся в них функциям, ресурсам и таблицам.

В отличие от Forex, в мире программирования применение DLL является широко распространённой практикой. Вы используете DLL каждый день, сами того не подозревая! Хотите убедиться? Откройте папку C:\Windows\System32 и посмотрите. Все эти файлы, на которых изображены две шестерёнки - это DLL.



Вы спросите: как же такое явление, как DLL, пришло на FOREX? Зачем?

Причин несколько.

Во-первых, программная среда MQL4 является сильно урезанной по отношению к тому же visual C, не говоря о C++. Банальное отсутствие WinAPI уже о многом говорит. Внедрение DLL позволяет использовать различные функции, недоступные рядовому MQL4-программисту. DLL переносят Вас на следующую ступень развития. С этой точки зрения, есть забавная аналогия: если MQL4-программист - это рабочий гоблин, то MQL4-программист, использующий DLL - это боевой орк

DLL позволяют, например, работать с окнами Windows, что бывает достаточно удобно, а в некоторых случаях просто необходимо.

Какие Вы знаете каналы общения Вашей программы с внешним миром (т.е. не с терминалом MT4)? Правильно - файлы. Но файлы - это работа с жёстким диском, а это - медленно (найти диск, дорожку, установить головку на нужный сектор...) А котировки всё идут и идут. На Forex иногда необходимо принимать решения молниеносно! А вот DLL как раз и позволяют это сделать! С помощью DLL можно организовать взаимодействие MT4 и того же MathLab, где, поверьте мне, все вычисления происходят в десятки раз быстрее.

С помощью DLL можно организовать взаимодействие нескольких советников, или даже нескольких терминалов! Как видите, у DLL много применений. В основном, из-за того, что они доступны очень многим разным видам приложений.

Во-вторых причина, которая, на мой взгляд, была основной при приходе DLL на Forex - защита от взлома! Многие владельцы коммерческих советников и индикаторов хотят защитить свои детища. И ни для кого уже не секрет, что обыкновенные компилки *.ex4 достаточно легко можно превратить в исходники *.mq4. А вот DLL-ку сломать сложнее. Для этого надо ковыряться в ассемблерном коде, а специалистов, умеющих это делать, среди трейдеров не так уж много.

Хочу также напомнить о том, что для MT4 файлы DLL хранятся в папке ...\\experts\\libraries\\...

C:\\Program Files\\MetaTrader Folder\\experts\\libraries

Надеюсь, Вам была понятна краткая справка по миру DLL и его сплетению с миром FOREX. На следующем занятии мы с Вами напишем свою первую DLL-ку. Не пропустите!

Читайте продолжение в следующем номере...

Если у Вас есть вопросы по материалу статьи, пишите нам с темой письма «MQL4».

[Написать письмо](#)

Мы обязательно ответим на Ваши вопросы в следующих номерах журнала. ■

Леонид Борский (leonid553)



Стаж работы на рынке Forex с января 2006 года. В сферу его интересов также входят фьючерсные инструменты товарных и фондовых рынков. Автор нескольких публикаций, в том числе и нашумевшей статьи «Нестандартная автоматическая торговля» <http://articles.mql4.com/ru/403> Леонид активно занимается кодингом и поиском нестандартных решений для автоматизации торговли.

КВАЗИАРБИТРАЖ В МТ4 (ЧАСТЬ 4)

(начало см. в №3, 4, 5 журнала «Leprecon Review»
<http://forum.leprecontrading.com/viewforum.php?f=92>)

Продолжаем знакомиться с методикой **Pairs Trading** - парной торговлей или, как ее еще называют, торговлей спредом. В первых трех частях статьи мы рассмотрели индикаторы, отображающие в отдельном окне на графике ценовые линии анализируемых инструментов и линию спреда Дельта, показывающую разность цен, а также примеры торговых «дуэтов». Напомню, что парная торговля (спред-трейдинг) состоит в открытии одновременно короткой и длинной позиций по фьючерсным контрактам на родственные инструменты и представляет собой операцию, в которой прибыль извлекается из относительного изменения цен этих контрактов. В данной статье мы рассмотрим пример советника для автоматической торговли на демо-счете по методике **Pairs Trading**.

Но сначала ответим на некоторые вопросы, присланные нашими читателями по предыдущим частям статьи. Судя по многочисленным письмам в редакцию, данная статья вызвала у читателей очень большой интерес.

Вопрос: (цитирую «без купюр») «В каком ДЦ велась торговля, сильно ли ДЦ ставило палки в колеса, ведь любая профитная торговля нежелательна для любого ДЦ?»

Ответ: На торговой платформе МТ4 экспериментальная парная торговля реализована в ДЦ ГК БРОКО и ДЦ IBCapital. Умышленных «палок в колеса» со стороны ДЦ замечено не было. Обычных же типичных мелких недоразумений, быстро решаемых техподдержкой, было не больше, чем в любом другом ДЦ. Более того, по просьбе клиентов техподдержка оперативно добавляла в ОБЗОР РЫНКА МТ4 дополнительные контракты по отдельным инструментам! Отмечу очень даже неплохую, полезную для парной торговли и своевременную фундаментальную аналитику по всем сегментам товарных рынков на форуме ДЦ IBCapital (не считите за рекламу...).

Вопрос: «Поясните в двух словах суть взаимодействия индикатора ценовых линий и индикатора линии спреда».

Ответ: Предполагается, что оптимальный парный вход реализуется при расхождении ценовых линий до примерного среднестатистического максимума и при одновременном начале разворота линии спреда Дельта от своего локального экстремума.

Вопрос: «Насколько корректно работает расчет размера лотов (контрактов) заданных инструментов в индикаторе линии спреда Дельта?»

Ответ: Расчёт отношения размеров лотов (контрактов) анализируемых инструментов лучше всего работает тогда, когда размерность обоих заданных инструментов котируется в одинаковой валюте и/или торгуются эти инструменты на одной площадке. Например, размеры фондовых индексов **DAX & FESX & FSTX** будут рассчитаны корректно. Также корректно будут рассчитаны размеры лотов «зерновых» фьючерсов (**ZW, ZC, ZS, ZM, ZL, ZR**) в любой их

комбинации. А вот тандем фондовых индексов **DAX & NQ** или сырьевой «дуэт» **BRN & ROSN** потребуют дополнительного скрупулезного ручного расчета, т.к. торгуются инструменты на разных площадках и котируются в разных валютах, - в евро & долларе и евро & рублях соответственно.

Вопрос: «Почему так мало «чисто-валютных» примеров в вашей статье?»

Ответ: Считаю, что данная методика в гораздо большей мере подходит для фьючерсных инструментов товарного и фондового рынка. Что же касается валют, то ими проще и целесообразнее торговать не «дуэтом» валютных пар, а одиночным кроссом от этого дуэта, используя типичный фундаментальный и технический анализ. Парная методика торговли в большинстве случаев будет здесь избыточной.

Итак, вернемся к заявленной теме - советник для автоматической торговли. Сразу отметим, что в нем предусмотрено два режима работы эксперта – по «всем тикам» и по «ценам открытия». Нужный режим работы выбирается переключателем в Свойствах советника. Режим работы по «ценам открытия» более целесообразен перед выходом значимых фундаментальных новостей по торгуемым инструментам, что позволяет избежать излишне раннего парного входа. Критерии генерирования сигналов для парного входа могут быть различными. Мы выстроили структуру советника так, чтобы любой пользователь, хоть немного владеющий навыками программирования, мог задать свои собственные условия входа. В предлагаемой же версии парный вход обусловлен отклонением величины текущего спреда от некоторого среднестатистического спреда за заданное число последних баров. Иначе говоря, специальная функция рассчитывает средний арифметический спред анализируемых инструментов за то число последних баров **N_Bars**, которое мы задаем в Свойствах советника. Спред при этом рассчитывается как отношение цен заданных инструментов, т.е. цены не вычитаются, а делятся одна на другую. Это сделано для того, чтобы пользователь мог без труда задать корректную работу советника на инструментах с разными размерностями, например, **6C & CL** или **6N & GC**.

Вот простейший код такой функции расчета среднестатистического спреда:

```
//===== Функция расчета среднестатистического спреда =====+
double AvarageSpread(string Symbol_1, string Symbol_2,int Timeframe,int NBars)
{
    int k;    double N = 0;    double Sum = 0;
    for(k = Last_bars; k < iBars(Symbol_1,Timeframe); k++)
    {
        if(N == NBars) break;//- задаем число баров для расчета
        int symb2Shift = iBarShift(Symbol_2,Timeframe,iTime(Symbol_1,Timeframe,k),true);
        if(symb2Shift != -1)// - синхронизируем бары
        {
            Sum += iClose(Symbol_1,Timeframe,k) / iClose(Symbol_2,Timeframe,symb2Shift);
            N++; }// - вычисляем суммарный спред на заданном количестве баров
        }//Далее, вычисляем среднестатистический спред :
    double avarageSpread = Sum / N;
    return(avarageSpread); }//конец функции
//-----+
```

Параметр **NBars** как раз и задает количество баров для расчета. Но особого внимания здесь заслуживает параметр **Last_bars**. Он также заявлен во внешних параметрах советника и задает количество самых последних баров (обычно от 1 до 3-х), не задействованных в расчете величины среднестатистического спреда. Для чего это сделано? Такой ход зачастую позволяет не пропустить профитный вход при работе на малых таймфреймах. Иначе говоря, при боковом, но энергичном, волатильном движении цен инструментов советник будет оперативно «ловить» любые сколь-нибудь значимые отклонения от среднестатистической величины спреда и генерировать быстрые краткосрочные профитные парные входы. При

работе на более крупных таймфреймах этот параметр более целесообразно задать равным единице или нулю.

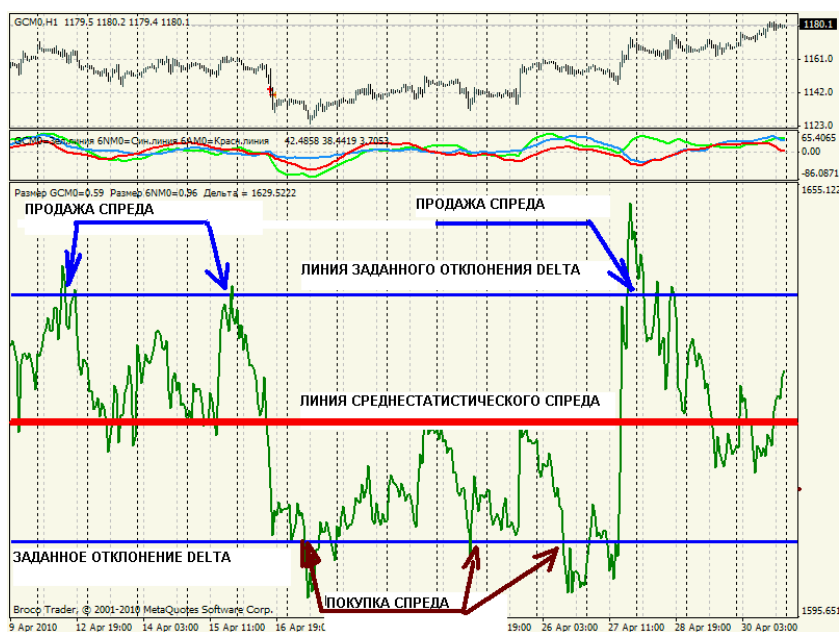
Механизм парного входа реализован следующим образом. Одновременно с расчетом среднестатистического спреда за **N_Bars** баров в коде предусмотрен расчет текущего спреда **Delta_Spread** на последнем (текущем) баре по текущим ценам BID. И на каждом тике или на каждом баре (в зависимости от выбранного режима работы) сравниваются величины текущего и среднестатистического спреда. Как только отклонение текущего спреда от среднестатистического превышает заданную в Свойствах советника величину **Delta_Deviation**, то реализуется **покупка** (покупка первого + продажа второго инструмента) спреда или **продажа** (продажа первого + покупка второго) спреда, в зависимости от того, вниз или вверх отклонился текущий спред на заданную величину.

Вот так это реализовано программно:

```
If ( Delta_Spread > 0 && Delta_Deviation <= Delta_Spread )
//если текущее отклонение выше заданного значения Delta, то
//продаем 1-й инструмент и покупаем второй (т.е. продаем спред)
TradeDOWN = true;      else TradeDOWN = false;
//-----
If ( Delta_Spread < 0 && Delta_Spread <=(-1)* Delta_Deviation)
//если текущее отклонение ниже заданного значения Delta, то
// покупаем первый и продаем 2-й инструмент (т.е. покупаем спред)
TradeUP =true;         else TradeUP =false;
```

Delta_Spread – динамичное текущее отклонение (т.е. разность между текущим и среднестатистическим спредами).

На рисунке ниже мы наглядно отобразили описанный механизм входа. Для фьючерсных инструментов **GC & 6A** (золото и новозеландец) на таймфрейме H1. Красная линия в окне индикатора – это уровень величины среднестатистического спреда, рассчитанного примерно по последним 300-350 барам. Эта линия достаточно инертна и, по мере движения цены, перемещается очень медленно. Синими линиями отображены границы заданного отклонения, которые, по мере движения цены, также дрейфуют вслед за красной линией. Когда динамичная (зеленая) кривая линия текущего спреда достигает граничной синей линии, то реализуется парный вход, т.е. покупка или продажа спреда, в зависимости от того, нижней или верхней границы достигла линия текущего спреда. (Индикатор расчета и отрисовки текущей линии спреда по отношению цен торгуемых инструментов прилагается к статье вместе с файлом советника).



Закрытие позиций реализовано в советнике по достижению заданного суммарного профита парной сделки в валюте депозита. Опция выполнена отключаемой, т.е. автоматическое закрытие можно отключить параметром **Close_Profit= False** и отслеживать текущий суммарный результат самостоятельно с последующим ручным закрытием. Предусмотрена также установка стоплосса и тейкпрофита, но для парной торговли их не рекомендуется задавать «по определению», поскольку при этом выхолащивается изначальный смысл спред-трейдинга. Внешние параметры советника легко читаемы и понятны:

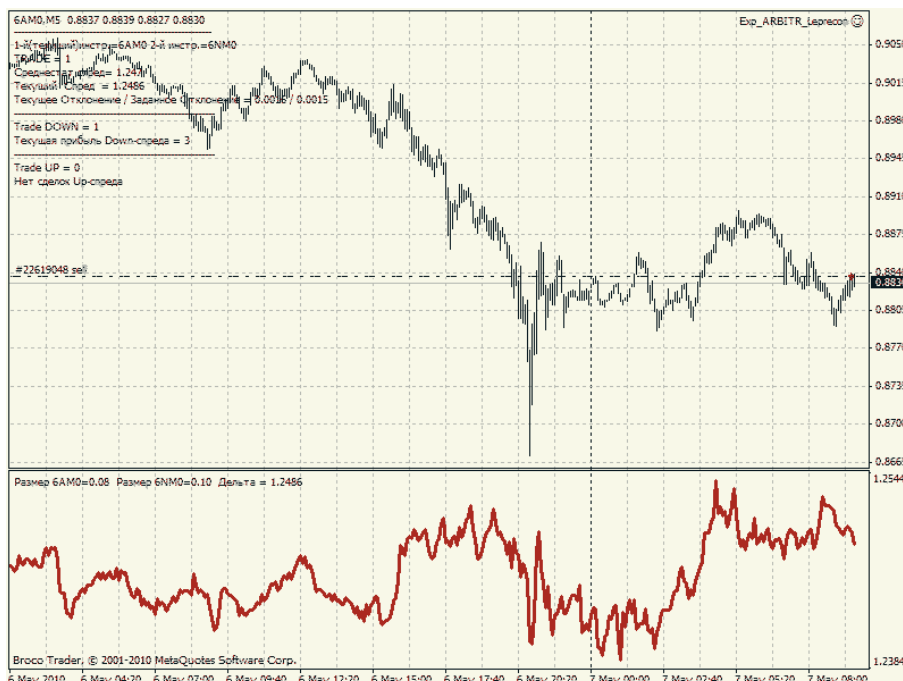
```
Magic      = 7778; //идентификационный номер
Open_Bar   =false; //Переключатель работы "по ЦЕНАМ ОТКР/по ВСЕМ ТИКАМ"
TRADE      = true; //выключатель открытия позиций(на закрытие не влияет)
N_Bars     =55;    //кол-во баров для расчета среднестат. спреда
Last_bars  =1;    //число последних баров, исключенных из этого расчета
Delta_Deviation = 0.005; //Отклонение от среднестат. значения спреда для сигнала входа
"=== Параметры 1-го инструмента ===";
Symbol_1   = "ESM0"; //Наименование 1-го инструмента
Lots_1     = 0.2;    //Размер лота первого инструмента
StopLoss_1 =0;      //стоплосс в пунктах
TakeProfit_1=0;     //тейкпрофит в пунктах
"=== Параметры 2-го инструмента ===";
Symbol_2   = "NQM0"; //Наименование 2-го инструмента
Lots_2     = 0.3;    //Размер лота второго инструмента
StopLoss_2 =0;      //стоплосс в пунктах
TakeProfit_2=0;     //тейкпрофит в пунктах
"=== Ф-я закрытия по заданному профиту ===";
Close_Profit= true; //выключатель функции закрытия
CloseProfit =33.0;  //размер суммарного профита(задается валютой депозита)
//-----
"- Параметры исполнения откp/закpытия позиций ";
UseSound   = True;  // Использовать звуковой сигнал
NameFileSound = "expert.wav"; // Наименование звукового файла
clOpenBuy  = Blue;  // Цвет открытия покупки
clOpenSell = Red;   // Цвет открытия продажи
clModifyBuy = Aqua; // Цвет значка модификации покупки
clModifySell = Tomato; // Цвет значка модификации продажи
clCloseBuy  = Yellow; // Цвет закрытия покупки
clCloseSell = Green; // Цвет закрытия продажи
NumberOfTry = 15;   // Количество попыток
SoundSuccess = "ok.wav"; // Звук успеха
SoundError   = "timeout.wav"; // Звук ошибки
```

В советнике предусмотрен блок отображения информации. С первым тиком после включения советника в левом верхнем углу графика отображаются наименования заданных инструментов и величина среднестатистического спреда на заданном баре, а также текущий спред, текущее отклонение спреда, заданное отклонение спреда. Если советником открыты позиции, то дополнительно отображается текущая суммарная прибыль.

Вот таким образом это будет выглядеть в процессе работы советника:



Некоторым недостатком «информационного блока» эксперта является обновление отображения текущей «печатной» информации только с приходом очередного тика того инструмента, на графике которого установлен советник. Поэтому желательно устанавливать советник на графике более волатильного инструмента рабочего «дуэта». Также желательно на этом же графике установить прилагаемый индикатор спреда - для наглядности и для удобства установки начальных параметров расчета отклонения спреда. Для тех читателей, которые только начинают вникать в технику автоматической торговли в МТ4, мы установили в СВОЙСТВАХ советника примерные параметры по умолчанию для работы на тандеме родственных валютных инструментов **6A & 6N** (валютные фьючерсы австралийца и новозеландца). Советник при этом устанавливается на график австралийца 6A, таймфрейм М5 (см. рис. ниже). Предполагается, что в таком режиме за день работы советник отработает несколько разнонаправленных парных входов. И пользователь, отслеживая ситуацию, получит небольшой начальный навык для своих последующих экспериментов.



В советнике задействованы пользовательские функции от известного программиста MQL Игоря Кима:

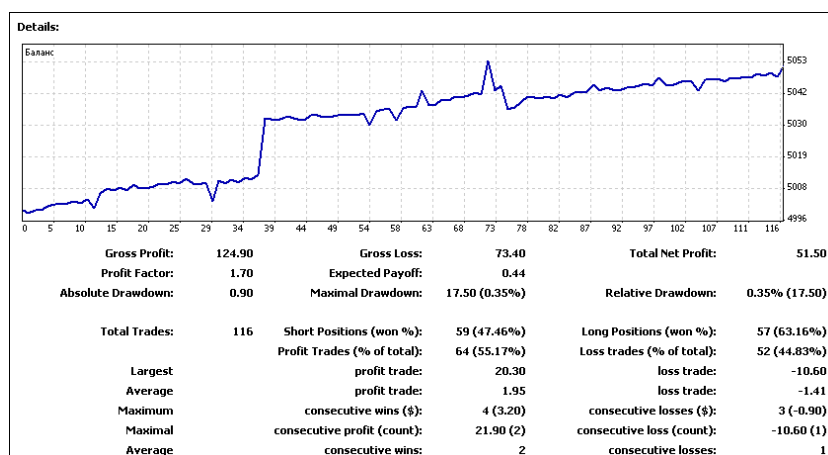
OpenPosition() – функция открытия позиций;

ModifyOrder() - функция модификации ордера;
 NumberOfPositions() - функция возвращает количество позиций;
 GetNameOP() - функция возвращает наименование торговой операции;
 GetNameTF() - функция возвращает наименование тайм-фрейма;
 ExistPositions() - возвращает флаг существования позиций;
 ClosePosBySelect() - закрытие выбранной позиции;
 ClosePosFirstProfit() - функция закрытия позиций по рыночной цене;
 GetProfitOpenPosInCurrency() - возвращает профит выбранной позиции.

Благодаря использованию этих функций удалось свести к минимуму сложные программные решения и привести код к «читабельному», простому и удобному виду, а также значительно повысить качество исполнения приказов советника на открытие/закрытие позиций и обработки ошибок сервера. Мы не стали здесь разбирать и скрупулезно вникать в структуру и работу этих функций, т.к. цель данной статьи вовсе не в этом, а в освоении навыков практической работы по методике **Pairs Trading**.

Повторюсь, что советник предназначен только для работы на демо-счетах (соответствующее условие задано в коде эксперта). Напоминаю также, что в приложении вместе с файлом советника имеется файл индикатора, где спред рассчитывается по отношению цен анализируемых инструментов.

Привожу график роста баланса за один месяц торговли (март 2010 г.). Использован постоянный лот 0.01:



В одном из следующих номеров журнала мы планируем рассказать об использовании многолетних сезонных тенденций при реализации парной торговли.

Удачи всем! ■

Советник выкладывается в компилированном виде, чтобы избежать его нелегального распространения и спекуляций, связанных с перепродажей советника. Все права на данный советник принадлежат автору.

[Скачать советник](#)

Код индикатора приводится в открытом виде с целью изучения нюансов программирования. Все права на данный индикатор также принадлежат автору.

[Скачать индикатор](#)

Если у Вас возникли вопросы по изложенному материалу, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

[Написать письмо](#)

Марсель Тазетдинов



Доверительный управляющий на рынке валютных фьючерсов, в том числе FOREX. Торговый стаж 3 года, высшее экономическое образование по специальности финансист. Ведущий блога «О правильной биржевой торговле». Резидент закрытого клуба о финансовых рынках «Bloomberg».

Здравствуй, дорогой читатель!

В [прошлом номере журнала](#) мы подвели итог концепции объемного анализа, и нам настолько понравилась идея «освещать не освещенное», что мы решили продолжить это благородное дело. Сегодня мы будем говорить об опционах. Поясню, почему. Уже не первый год я являюсь доверительным управляющим, и самый популярный вопрос, который потенциальный инвестор задает мне: «Каковы риски?». Вопрос этот очень хороший, потому что контроль риска - это единственный параметр в торговле, который нам действительно подвластен, остальное - это всего лишь теория вероятности. Как сказал один мой приятель с ЖЖ: «Я хочу научиться не терять, а заработать - само получится». И в этом плане опционы как инструмент защиты от риска очень хороши.

ВВЕДЕНИЕ В ОПЦИОНЫ



Смотрим Википедию:

Опцион (от лат. «optio» - выбор, желание, усмотрение) - это договор, по которому потенциальный покупатель или потенциальный продавец получает право, но не обязательство, совершить покупку или продажу актива (товара, ценной бумаги) по заранее оговорённой цене в определённый договором момент в будущем или на протяжении определённого отрезка времени.

Опцион — это один из производных финансовых документов. Различают опционы на продажу (put option), на покупку (call option) и двусторонние (double option).

ФУНДАМЕНТАЛЬНЫЕ ПОНЯТИЯ

Не все из нас являются профессиональными опционными трейдерами, некоторые только начинают интересоваться акциями, биржей, опционам и т.д. Поэтому всё нижеследующее будет в большей степени адресовано только начинающим опционным трейдерам. Хотя, быть может, и остальным тоже будет интересно. Прежде, чем начать торговать на рынке и рисковать своими деньгами, необходимо узнать правила этого рынка и его фундаментальные понятия. Так как именно эти знания в дальнейшем послужат вам неким мостиком для перехода к построению других более сложных стратегий, а, в конечном итоге, и к успешной торговле.

Существует несколько базовых стратегий. Но для того, чтобы вы могли успешно применять их в своей торговле, прежде чем мы приступим к их разбору, нам нужно ознакомиться с

более простыми основными понятиями.

Итак, два самых простых понятия на рынке – это опцион Call и опцион Put. Именно они являются ядром практически всех опционных стратегий.

Опцион Call - это право, но не обязательство, купить базовый актив по указанной цене в указанную дату.

В противоположность ему, **опцион Put** – это право, но не обязательство, продать базовый актив по указанной цене в указанную дату.

Любой из этих опционов может быть как куплен, так и продан. Эти две операции означают лишь то, на какой вы стороне, и что, соответственно, вы имеете права, как покупатель, или обязательства, как продавец.

Вот теперь мы готовы рассмотреть основные базовые стратегии.

1. **Длинный опцион Call.** Это значит, что мы с вами купили опцион Call в надежде на то, что рынок будет расти. Длинный опцион Call является самым лёгким в понимании инструментом и пользуется, наверное, наибольшей популярностью в построении других более сложных стратегий. Допустим, фьючерс на индекс РТС торгуется по 62000, и мы имеем купленный опцион Call 60000. Страйк 60000 означает, что при исполнении этого опциона мы имеем право купить фьючерс не по рыночной цене 62000, а по цене исполнения – 60000. И тогда у нас будет открыта длинная позиция по фьючерсу. Но если цена фьючерса до экспирации успеет опуститься ниже страйка нашего опциона, то он истечёт бесполезным.

2. **Короткий («голый») опцион Call.** Это значит, что мы с вами продали опцион Call. Слово «голый» означает, что мы не имеем базового актива в том случае, если нам придётся выполнять обязательство по продаже (поставке) базового актива. Допустим, фьючерс на индекс РТС торгуется по 62000, и теперь мы уже имеем проданный опцион Call 60000. Тогда, в случае исполнения опциона, мы будем обязаны продать фьючерс не по рыночной цене 62000, а по цене страйка 60000. И тогда у нас будет открыта короткая позиция по фьючерсу. Поэтому прибыль продавец опциона Call получит лишь в том случае, если цена фьючерса будет ниже страйка проданного опциона или выше страйка, но не больше, чем величина полученной премии.

3. **Длинный опцион Put.** Это значит, что мы купили опцион Put. Здесь мы надеемся на снижение рынка. Допустим, фьючерс на индекс РТС торгуется по 60000, а мы с вами имеем купленный опцион Put 62000. Тогда при его исполнении мы имеем право продать базовый актив по цене страйка, то есть по 62000, и занять короткую позицию по фьючерсу. Поэтому прибыль мы получим, если цена фьючерса окажется ниже цены страйка нашего опциона. Если она будет выше, то опцион истечёт бесполезным.

4. **Короткий опцион Put.** Это значит, что мы продали опцион Put. В этом случае мы с вами рассчитываем на рост рынка, но, быть может, не такой значительный, как в случае покупки опциона Call. Тогда, если рынок действительно будет выше цены страйка проданного опциона Put, то нашей прибылью будет полученная премия за опцион. Но если рынок будет ниже цены исполнения опциона, то мы с вами можем понести неограниченные убытки.

Используя особенности и свойства каждой из 4-х вышеперечисленных стратегий, мы можем строить другие более сложные стратегии, которые могут быть использованы как для получения дохода, основанного на спекуляциях, так и для хеджирования – защиты от рисков - или даже комбинировать и то, и другое. Например, самыми простыми стратегиями, основанными на продаже и покупке опционов, являются спреды. Бычьи или медвежьи спреды прекрасно подходят для использования на любом рынке. Спреды строятся на одновременной покупке и продаже опционов одного типа на различных страйках с одинаковой датой исполнения.

Бычий спред строится из длинного опциона Call/Put на более низком страйке и короткого опциона Call/Put на более высоком страйке.

Медвежий спред строится из длинного опциона Call/Put на более высоком страйке и короткого опциона Call/Put на более низком страйке.

Любую стратегию вы можете построить в SmartOptionView® и наглядно посмотреть, какие вы будете иметь профили прибылей и убытков.

ГРЕКИ

Начиная изучать опционы, многие задаются вопросом, а что же такое “греки”, как их читать, и зачем вообще они нужны. Есть много литературы, в которой написано языком формул и выводов про эти замечательные опционные характеристики – “греки”. Но опустим сложные формулы и попробуем описать “греки” более доступным языком. Мы не ставим целью в этой публикации раскрыть всю информацию о “греках”, а лишь попытаемся дать понятные определения и привести некоторые примеры их использования.

Как известно, основной моделью ценообразования опционов является модель Блэка-Шоулза. В данную модель включены такие переменные, как «цена базового актива», «цена страйк», «количество дней до истечения», «волатильность», «размер безрисковой процентной ставки». Подставляя эти данные в формулу, мы получаем теоретическую стоимость опциона. Если мы будем менять какой-либо из вышеуказанных параметров в формуле, имитируя различные рыночные условия, то мы будем, так или иначе, получать различные цены опциона, соответствующие этим условиям. “Греки” – это опционные характеристики, описывающие чувствительность цены опциона к переменным модели, описанным выше. Свое название они получили от букв греческого алфавита, которыми обозначается каждая из переменных. Например, как изменится премия опциона, если цена базового актива изменится на единицу? Это “Дельта”. Или как изменится премия опциона, если волатильность изменится на единицу? Это “Вега”. Есть еще “Гамма”, “Тетта” и “Ро”.

Позволим себе немного отклониться от темы и вспомнить всем знакомые и многими любимые точные науки – математику и физику. Все когда-то учились в школе и проходили там исследование функции. Так вот, неотъемлемым методом исследования различного рода функций является ПРОИЗВОДНАЯ. Все когда-то слышали это понятие. Если кто-то еще не вспомнил, что это такое, то напомним: попросту говоря, производная – это скорость изменения функции. Обращаясь к физике, все помнят, как мы решали задачку «скорость, умноженная на время, равняется пройденному пути»? Так вот, производная пути по времени и есть скорость. В общем, я о том, что производная и скорость изменения чего либо – это синонимы. Зачем нам все это? Затем, что модель Блэка-Шоулза – это тоже функция. Но эта функция нам интересна тем, что она многопараметрическая, и, беря различного рода частные производные, мы можем получить скорости изменения премии опциона от изменения параметров модели.



“Греки” – это скорости изменения премии опциона от изменения параметров опциона на единицу или величины, на которые изменится цена опциона, если базовые параметры изменятся на единицу.

Всего греков пять. Можно было бы объяснить их количество тем, что всего у формулы пять параметров, но это не совсем так. Несмотря на то, что параметров действительно пять, мы имеем один параметр, фиксированный во времени –

это страйк. Остальные параметры динамически изменяются во времени, чем, собственно, и интересны. Но откуда пять греков? Обо всем по порядку.

“Грек” номер один – “Дельта”. “Дельта” есть не что иное, как скорость изменения премии опциона относительно изменения цены базового актива. Другими словами, “дельта” показывает, на сколько изменится цена опциона, если цена базового актива изменится на один пункт. С математической точки зрения, “дельта” есть первая производная модели Б-Ш по цене базового актива. Для чего же нам нужна и чем так полезна “дельта”? “Дельта”, пожалуй,

самая основная и самая важная характеристика опциона. При помощи "дельты", владея опционом, можно определить эквивалент позиции в базовом активе. К примеру, при помощи нехитрого преобразования можно получить позицию по опционам, которая будет вести себя также (изменяться в цене), как позиция по фьючерсам.

Возьмем, к примеру, опцион (Call), если цена базового актива значительно выше цены страйка (опцион "в деньгах"), то премия опциона ведет себя так же, как и цена базового актива. При изменении цены базового актива на один пункт, премия опциона тоже изменится на один пункт. Дельта в этом случае =1. Если цена базового актива будет меньше страйка (опцион "без денег"), то премия опциона не будет существенно меняться, потому что опцион не будет стоить практически ничего, т. е. "дельта" = 0 или близка к нулю. Данный пример получен путем существенного упрощения модели, в реальности же мы имеем далеко не нулевую премию опциона, если цена базового актива упала ниже страйка. Это объясняется наличием временной стоимости. Опционы "около денег", как правило, имеют "дельту", равную 0.5.

Все это говорит о том, что опционы "в деньгах" изменяются в цене наравне с базовым активом, опционы "вне денег" почти не меняются в цене, а опционы "около денег" изменяются со скоростью, приблизительно равной одной второй скорости базового актива. Отсюда достаточно просто можно сделать вывод о создании эквивалентной позиции. Например, если мы знаем, что премия опциона "около денег" изменяется со скоростью одной второй, то вместо одного базового актива (например, фьючерс на акцию) мы можем приобрести два опциона "около денег". Таким образом, мы можем получить эквивалент позиции базового актива и наши опционы "около денег" будут изменяться с той же скоростью, что и базовый актив. Подведем итог - для того, чтобы получить эквивалент позиции по базовому активу в любой момент времени, надо умножить количество купленных опционов на их дельту. Есть один момент, на который надо обратить внимание. Данная формула справедлива для расчета эквивалентной позиции, когда базовый актив - фьючерс. Если же базовый актив - акция, то формулу надо еще умножить на количество акций в лоте опциона. Об этом надо помнить. Где это применяется? Основное применение "дельты" - это расчет хеджирующих позиций в сложных опционных стратегиях. Например, если мы имеем позицию в 10 фьючерсов на индекс и хотим захеджировать ее от падения, мы можем рассчитать эквивалентную позицию по опционам, необходимую для хеджирования этих самых 10 контрактов путем покупки Put опционов. Или другой пример, цена базового актива выросла на 10 рублей, а опционная премия выросла на 5. Имеем "дельту" 0,5 или 50%. То есть теперь понятно, что, владея 10 опционами на фьючерс, в данном примере мы имеем позицию, эквивалентную 5 фьючерсам. Ввиду ограниченности охвата статьи, пример предлагаем решить вам самим.

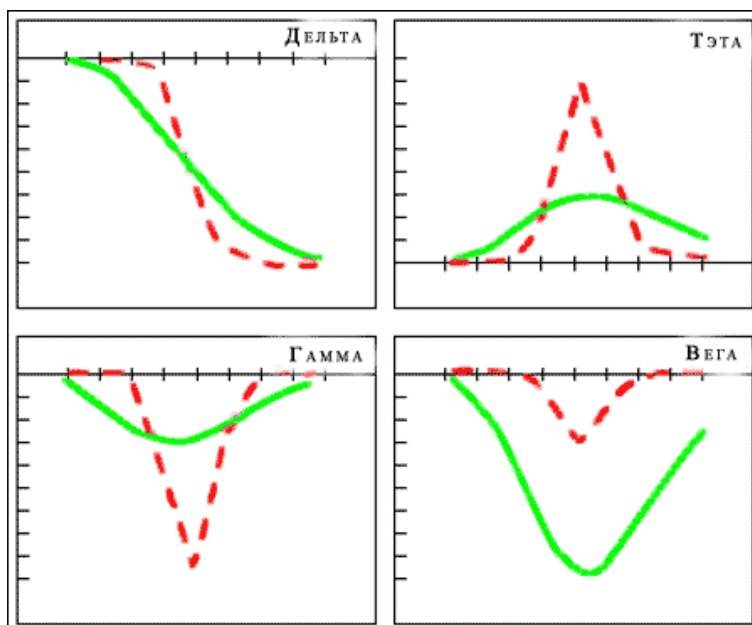
"Гамма" – это "грек" номер два. "Гамма" – это тоже скорость изменения. Только вот чего? "Гамма" показывает скорость изменения дельты опциона, если цена базового актива изменилась на единицу. Математики могут догадаться, что "Гамма" есть не что иное, как вторая производная модели БШ по цене базового актива. Из физики мы знаем, что вторая производная показывает нам ускорение или скорость изменения скорости. В нашем случае "гамма" – это скорость изменения "дельты". Зачем она нужна? "Гамма", как и оставшиеся "греки", является инструментом тонкой настройки опционных портфелей и применяется для оценки риска создаваемой позиции. Чем больше "гамма", тем быстрее будет изменяться "дельта", тем быстрее будет изменяться цена опциона, тем больший риск будет по открытой позиции. Если быть более детальным, то, взглянув на график "гаммы" опционной дельта-нейтральной стратегии (пусть дельта Call равна 0.5, и мы имеем 1 короткий фьючерс против двух купленных опционов Call, страйки и цены сейчас не важны, важно только то, что суммарная "дельта" равна нулю), можно увидеть, что "гамма" выглядит в виде вытянутого пика вокруг страйка. Глядя на этот график, можно определить в каком диапазоне цена составленной позиции будет меняться быстрее всего, и где необходимо быть внимательным

и предпринять действия по сглаживанию этих колебаний. Сглаживание ценовых движений можно производить путем добавления положительной или отрицательной "гаммы" в текущую позицию покупкой или продажей опционов. Но используется все это чаще в стратегиях покупки и продажи волатильности, о чем мы обязательно поговорим отдельно.

"Тета"- третий по важности "грек". "Тета" характеризует скорость изменения премии опциона от времени до истечения или, говоря русским языком, сколько денег теряет опцион за один день. Еще этот параметр называют скоростью временного распада. Математически говоря, первая производная модели БШ по времени. В основном, применяется для оценки риска, связанного с временным распадом. В сложном портфеле показывает, сколько денег исчезает или прибавляется в стоимости позиции за прошедший день. Для опционов с далекой датой истечения имеет незначительную величину, но с течением времени "тета" увеличивается, ускоряя временной распад. Наибольший распад начинает ощущаться за две недели до истечения опционов. "Тета" - весьма полезный параметр для продавцов опционов.

"Вега" - это "грек", показывающий скорость изменения премии опциона от изменения волатильности на единицу, или первая производная по волатильности. "Вега" применяется при анализе опционов для оценки рисков позиции при изменениях волатильности. К примеру, на сколько изменится премия опциона при изменении волатильности на 1%. Большинство трейдеров игнорируют "Вегу", при этом она бывает весьма полезна при торговле волатильностью, да и затем, чтобы просто представлять себе, какой урон нанесет вашей позиции изменение волатильности на 1, 5 или 10%. Мы считаем, что сама внутренняя волатильность опциона является гораздо более показательным инструментом, нежели "Вега".

"Ро". Последний из "греков". Данный инструмент показывает скорость изменения премии опциона в зависимости от изменения процентной ставки без риска, или производную по процентной ставке, или на сколько изменится премия, если изменится процентная ставка. Данный инструмент, пожалуй, самый редко используемый. Дело в том, что процентные ставки меняются достаточно редко, и "Ро" не актуальна.



Греки проданного Колла.

Подведем итог. "Греки" – это характеристики опционов, которые показывают, как изменится цена опциона, если параметр "грека" изменится на единицу. Наиболее полезные греки – это "дельта", "гамма" и "тета". Они позволяют определить эквивалент позиции, оценить риск позиции и понять, сколько денег забирает временной распад. Еще раз хочу отметить, что целью

данной публикации являлось объяснить простыми словами сущность "греков" и попытаться описать их область применения без каких-либо сложных математических выводов и сложных деталей. Надеемся, у нас это получилось. Ну, а если, прочитав материал, возникло желание ознакомиться с "греками" поближе, мы предлагаем вам почитать литературу (Макмиллан «Макмиллан об опционах», Чекулаев «Риск менеджмент», Халл «Фьючерсы и опционы»), где можно почерпнуть более детальную информацию о характеристиках и свойствах "греков", а также рассмотреть графические представления изменения "греков", ведь все эти функции – нелинейны.

В следующем номере мы более подробно поговорим об опционных стратегиях.

В статье использованы материалы порталов www.optiontraders.ru и www.lowrisk.ru с разрешения авторов.

Удачной торговли. ■

ВНИМАНИЕ, ВЕБИНАР!

Напоминаем, что для желающих продолжить изучение темы торговли по объемам мы с Василием Грищенко (совладельцем и одним из разработчиков платформы VolFix) собираем возникшие вопросы, после чего проведем дополнительный вебинар по стратегиям торговли на основе объема.

Написать вопрос



Михаил Трофимов (Hunter_GB)

Треjder со стажем более 8 лет. В 2002 году начал разрабатывать для российского фондового рынка аналитические торговые системы, известные как «Gold Cross». С 2004 года торгует индексы, металлы, валютные пары, реже энергетику. Автор собственных разработок по торговым системам. Также занимается переводами, аналитическими обзорами, проведением тренингов по торговым системам.

ФРАКТАЛЬНО-ПИВОТНАЯ ТОРГОВАЯ СИСТЕМА

В этой статье описывается один из способов анализа финансовых рынков. Данная статья является продолжением статей, опубликованных в Leprecon Review №2 за январь 2010 г. (Price Channels) и №3 за февраль 2010 г. (Pivot Points). Применяя мультифрактальные индикаторы (в данном случае, MTF-Fractals.mq4 и Pivot Points), трейдер получает возможность анализировать рынок на выбранном им тайм-фрейме и совершать прибыльные сделки.

В настоящее время существует множество способов анализа финансовых рынков. Многие из них описывают методы, основанные на фундаментальном и техническом анализе. Однако в последнее время среди отечественных и зарубежных аналитиков стал применяться новый метод прогнозирования цен – фрактальный анализ. Билл Вильямс написал две книги – «Торговый хаос» и «Новые измерения в биржевой торговле» - и был первым, кто применил термин «фрактал» для торговли на финансовых рынках. Рынок – это сложная структура, образованная в результате многочисленной информации о той или иной валюте, движение которой происходит в зависимости от экономической ситуации в каждой стране. Существующая мировая финансовая структура находится в постоянном развитии. Кризис одной валюты не приводит к краху других валют, и система продолжает свое развитие.

ВОЗНИКНОВЕНИЕ ТЕОРИИ ФРАКТАЛОВ

Фрактал – самоподобная структура, чье изображение не зависит от масштаба. Это рекурсивная модель, каждая часть которой повторяет в своем развитии развитие всей модели в целом.

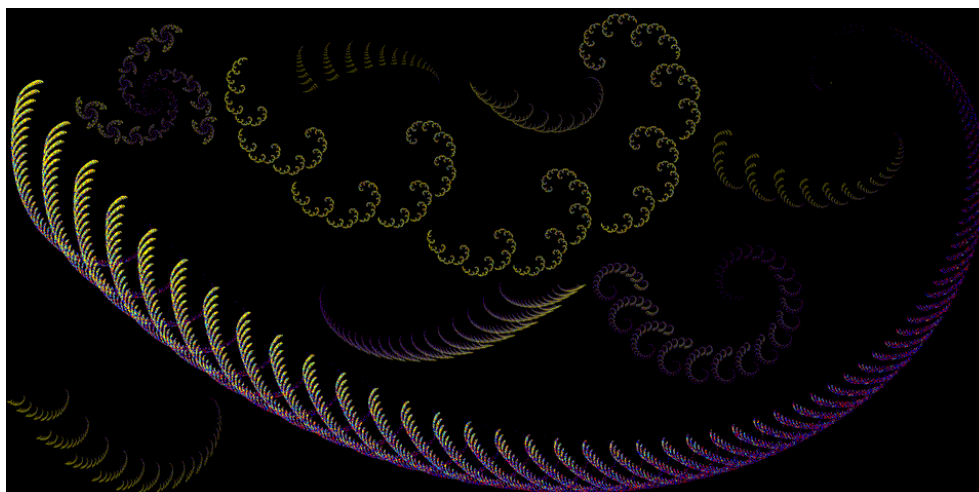


Рис. 1. При масштабировании рисунка фрактальные структуры сохраняют целостность.

Следует отметить, что слово «фрактал» не является математическим термином и не имеет общепринятого строгого математического определения. Оно может употребляться, когда рассматриваемая фигура обладает какими-либо из перечисленных ниже свойств:

* Обладает нетривиальной структурой на всех шкалах. В этом отличие фракталов от регулярных фигур (таких, как окружность, эллипс, график гладкой функции): если мы рассмотрим небольшой фрагмент регулярной фигуры в очень крупном масштабе, он будет похож на фрагмент прямой. Для фрактала увеличение масштаба не ведёт к упрощению структуры, на всех шкалах мы увидим одинаково сложную картину.

* Является самоподобной или приближённо самоподобной структурой.

* Обладает дробной метрической размерностью или метрической размерностью, превосходящей топологическую.

Анализ фракталов применяется практически во всех отраслях науки и техники. Фракталы вокруг нас повсюду - и в очертаниях гор, и в извилистой линии морского берега. Некоторые из фракталов непрерывно меняются, подобно движущимся облакам или мерцающему пламени, в то время как другие, подобно деревьям или нашим сосудистым системам, сохраняют структуру, приобретенную в процессе эволюции.

По сути дела, фракталы - это процессы самоорганизации. Они могут иметь самую различную природу: химическую, механическую, оптическую, электрическую и т. п. Принципы нелинейности и альтернативы выбора развития любого процесса или системы реализуются и при построении фракталов.

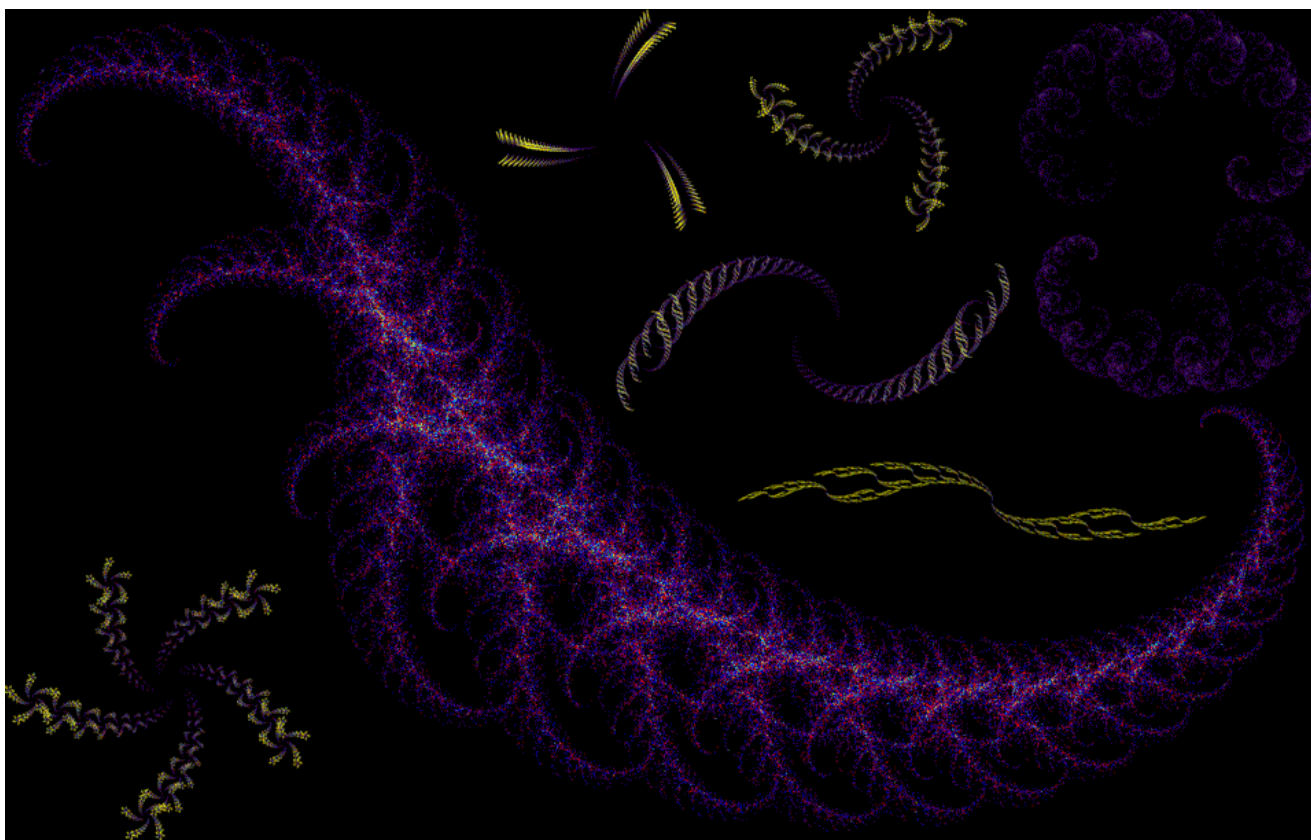


Рис. 2. Сгенерированные компьютером фракталы.

"Геометрия, которая описывает форму береговых линий и моделей галактик также хорошо объясняет, почему цены акций растут и падают".

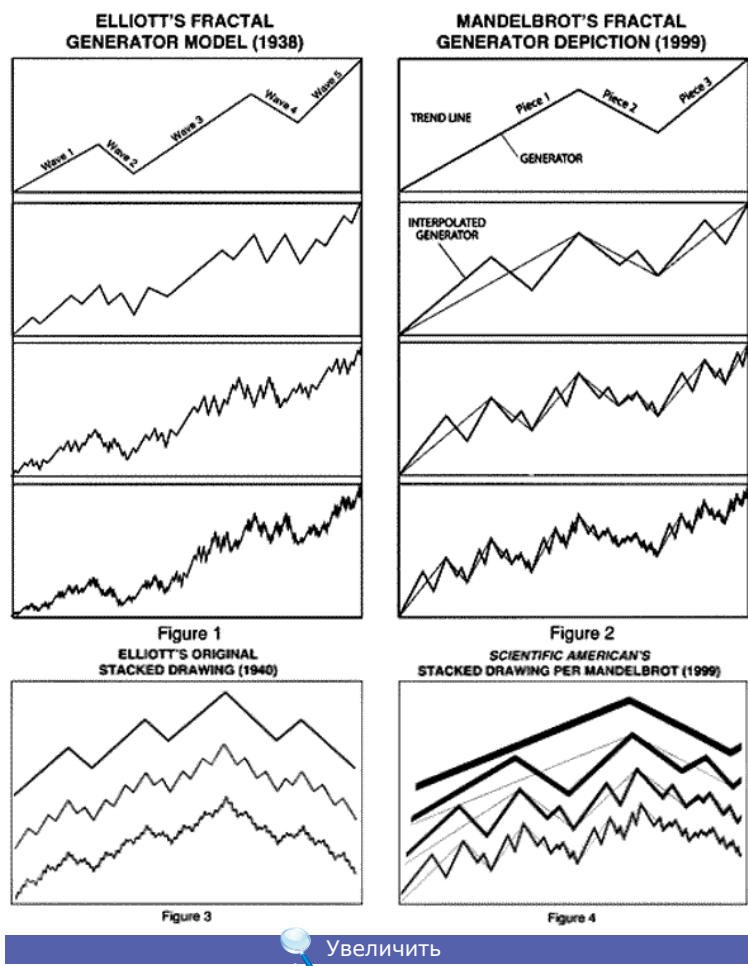
Benoit B. Mandelbrot

МУЛЬТИФРАКТАЛЫ И РЫНОК

Для фракталов и мультифракталов существует обширное математическое обоснование. Фрактальные модели появляются не только в изменениях котировок ценных бумаг, но и в распределении галактик в космосе, в форме береговых линий и в декоративных проектах, произведенных бесчисленными компьютерными программами.

Фрактал - геометрическая форма, которая может быть разделена на части, каждая из которых - уменьшенная версия целого. В финансах эта концепция - не беспочвенная абстракция, а теоретическая переформулировка практической рыночной поговорки, а именно, что движения акции или валюты внешне похожи, независимо от масштаба времени и цены. Наблюдатель не может сказать по внешнему виду графика, относятся ли данные к недельным, дневным или же часовым изменениям. Это качество определяет диаграммы как фрактальные кривые и делает доступными многие мощные инструменты из математического и компьютерного анализа.

Более специфический технический термин для подобия между частями и целым - самоподобность. Она связана со знаменитой концепцией фракталов, называемой самоподобием, в котором каждая деталь картины уменьшена или увеличена с одинаковым отношением - процесс, знакомый любому, кто когда-либо заказывал увеличение фотографии. Финансовые рыночные графики, однако, далеки от самоподобия.



Торговые системы, основанные на Fractals (MTF-Fractals.mq4) и Pivot Points (PPD-Shifted.mq4, PivotSystem (3D+Pdin)L - H_GB.mq4, PivotSystem (W+Pdin)L - H_GB.mq4), также опираются на понимание финансовых рынков как мультивалютных взаимообусловленных синергичных финансовых систем, которые имеют точки консолидации, а также точки разворота для последующего направления движения.

Теперь рассмотрим непосредственно индекс S&P как финансовый инструмент, характеризующий состояние экономики США.

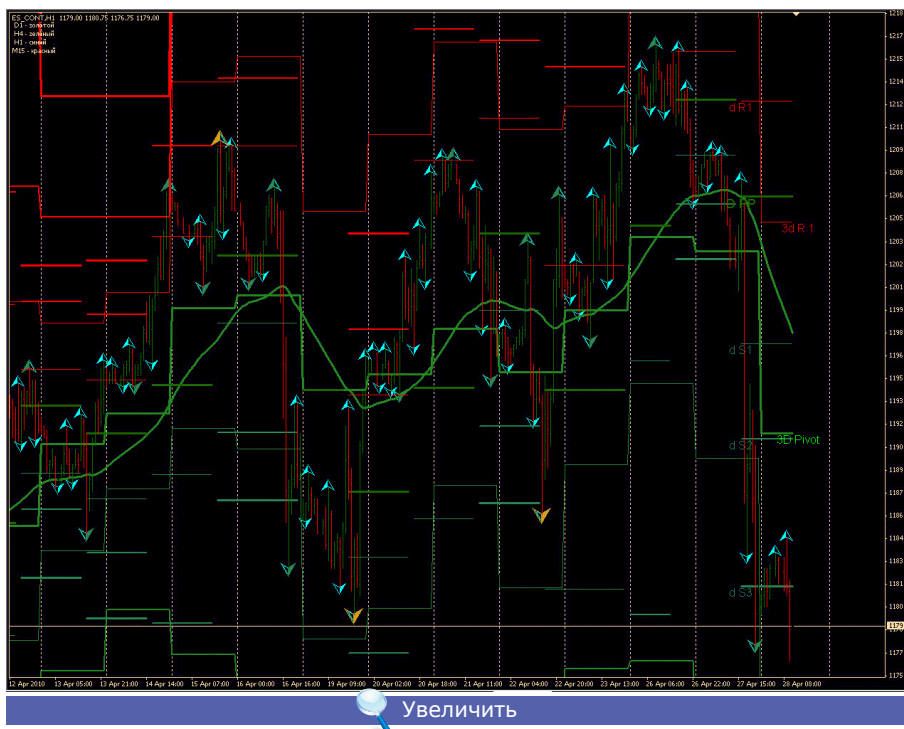


Рис. 4. S&P на таймфрейме 1 час.

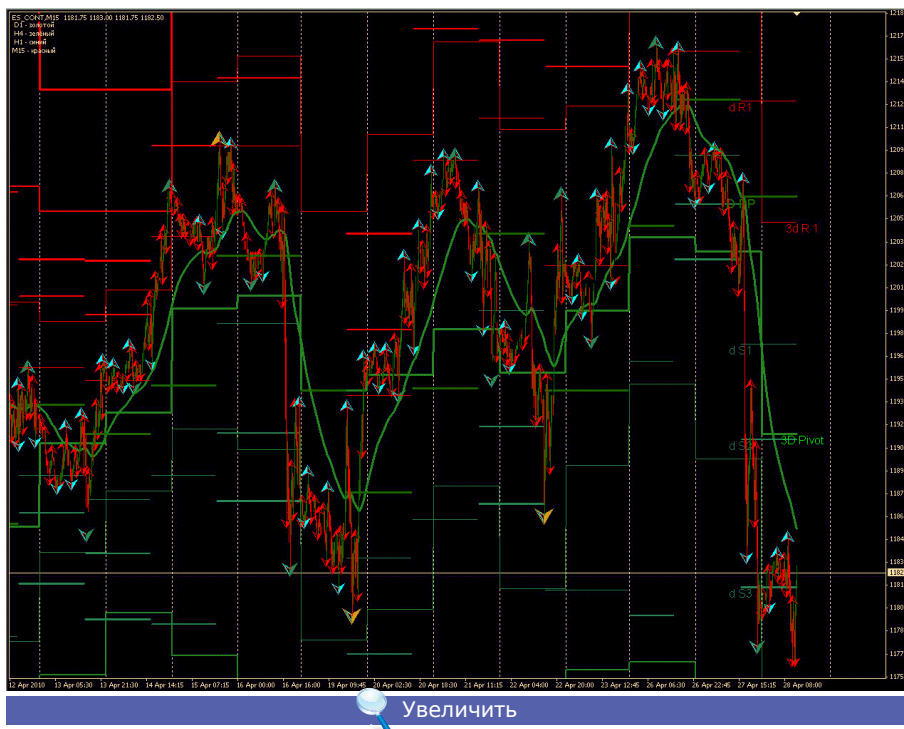


Рис. 5. S&P на таймфрейме 15 мин.

Очень хорошо видно, что фрактальные и пивотные сигналы формируются на значимых ценовых уровнях, которые определяются на истории – ретроспектива рынка. В то же самое время, формирование сигнала о консолидации, длительность консолидации и длительность тренда имеют различный пространственно-временной фактор. Сигналы имеют независимую структуру на различных ТФ, но их формирование – однообразно. Так называемый отсутствующий фрактал, который часто подтверждается увеличением или консолидацией пивотных уровней,

очень часто является возможной будущей целевой зоной формирования цены. Время целевой цены, или ценовой уровень, имеют различную длительность достижения. Подтвержденные фракталами и пивотами, ценовые уровни являются уровнями консолидации цены, уровнями разворота тренда, трендовыми ценовыми каналами и уровнями сопротивления/поддержки. При этом, эти уровни взаимопереходящи и часто повторяемы.

Фрактальная теория рынка предполагает то, что прошлые значения цены коррелированы (связаны) с ее будущими значениями. В этом можно убедиться самостоятельно, выбрав значимый максимум в прошлом и посмотрев, как цена пробивала или колебалась возле данного уровня (рейндж, консолидация, ретест и пробой). Как правило, значимость уровня выражается в импульсивных и мощных пробоях, либо в том, что цена не может пробить данный уровень.

Изучая прошлое поведение цены, обратите внимание на временные интервалы, на которых происходит горизонтальное движение цены – консолидация. Как правило, данное движение принято называть корректировочным (горизонтальный ценовой канал). Также есть моменты с сильными нисходящими и восходящими всплесками цены (пробой), и последующим равномерным движением цены (тренд). Как уже было сказано, принципы нелинейности и альтернативы выбора развития любого процесса или системы реализуются и при построении фракталов.

Таким образом и проявляется основной закон фрактально-пивотной торговой системы о рекурсивности финансовых рынков, растождествлении финансовых систем различных стран и самоорганизующемся подобию реактивного движения различных финансовых инструментов, в зависимости от глобальной финансовой системы и финансовых систем каждой страны.

Применение теории фракталов в экономике позволяет проводить фундаментальный и технический анализ финансовых рынков.

[Скачать видео по статье](#)

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ

1. Шейпак И.А. Фракталы, графталы, кусты... //Химия и жизнь. – 1996, №6.
2. Постигание хаоса //Химия и жизнь. – 1992, №8.
3. Эрлих А. Технический анализ товарных и фондовых рынков, М.: Инфра-М, 1996.
4. А.Алмазов. Фрактальная теория. Как поменять взгляд на рынки.
5. Мультифрактальная прогулка вдоль Уолл Стрит. //Журнал Scientific American. - 1999, февраль.
6. SeminarTsvetkov. Фрактальный анализ и его применение к исследованию временных рядов.
7. Материалы из сети Internet.

Оставайтесь с нами! ■

Если у Вас возникли вопросы по изложенному материалу, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

[Написать письмо](#)

ИНТЕРВЬЮ

Гостем нашей сегодняшней рубрики стал Член Совета директоров МФХ «FIBO Group» Максим Николаевич Анисимов.



Здравствуйте, Максим Николаевич. Компания «FIBO Group» существует на рынке уже много лет. Несмотря на это, Ваша компания не замечена в каких-либо крупных «разборках», невыплатах заработанного - количество претензий и жалоб можно считать минимальным, особенно по сравнению с некоторыми ДЦ. Как Вам это удается?

Это наш принцип, мы всегда стараемся исполнять взятые на себя обязательства. Мы ценим свою репутацию и своих клиентов, поэтому стараемся не допускать конфликтных ситуаций, а в тех редких случаях, когда они происходят, подходим к решению вопросов объективно и непредвзято.



Какие преимущества Вашего ДЦ Вы бы выделили в качестве основных? Какие из них отличают «FIBO Group» от остальных дилинговых центров?

Отсутствие нареканий на работу с нами уже говорит о многом, особенно о том, что несмотря на то, что на рынке мы выступаем, в том числе, и как маркет-мейкер, мы никогда не используем это в свою пользу, исполнение ордеров в нашей компании одно из лучших. Это первое преимущество. Вторым преимуществом является то, что мы платим – всегда! Сколько бы человек не заработал - мы это выплатим. По мне, это главное для трейдера - быть уверенным в своем брокере, в том, что всегда можно совершить сделку и получить заработанное.



Продолжительное время минимальный лот при торговле в Вашей компании составлял 0.1 лота. С чем было связано решение компании о введении микро-лотов 0.01?

Ввод микро-лотов был связан с большим интересом наших клиентов, а желание клиента, как известно, закон.

Кроме того, мы понимаем, что при минимальном депозите в \$300, клиентам, которые хотят оценить наш сервис на реальном счете, довольно сложно соблюдать правила манименеджмента (money management), торгуя десятитысячными контрактами.



Продолжая тему нововведений, обратимся к не так давно появившейся возможности открывать ПАММ-счета в компании «FIBO Group». Есть ли какие-то особенности у этого типа счетов относительно ПАММ-счетов, открытых в других компаниях?

Торговля на ПАММ-счете ничем не отличается от торговли на обычном счете в компании FIBO Group, Ltd. Поэтому, можно сказать, что отличия существуют не между ПАММ счетами, открытыми в разных компаниях, а между собственно торговлей в FIBO и в других компаниях - а эта тема уже рассматривалась выше.



Еще одним нововведением можно назвать отдельный сайт с образовательными курсами «FIBO Study». Цитируем одну фразу с сайта: «Вам будут доступны учебные курсы, проверка знаний и многое другое, что поможет Вам стать успешным трейдером на рынке Forex». А вопрос, волнующий многих наших читателей, заключается в следующем – сколько, по Вашему мнению, нужно времени, чтобы стать успешным трейдером?



Начинающие трейдеры не являются нашей целевой аудиторией. Мы больше сфокусированы на удовлетворении потребностей опытных трейдеров, которые в состоянии оценить наши усилия, направленные на постоянное улучшение качества дилинга, продуктов и торговых условий.

Обучение не является приоритетным направлением нашей компании, мы не обучающий центр, мы – компания-дилер. Наша задача - предоставлять качественные услуги по торговле на финансовых рынках. Несмотря на это, мы хотели внести свой вклад в повышение финансовой грамотности, из этой идеи и вырос данный проект.

А на сам вопрос, сколько требуется времени, чтобы торговать успешно, ответить однозначно нельзя: кому-то это вообще не суждено, а у кого-то может получиться достаточно быстро. Но основная идея в том, чтобы научиться зарабатывать стабильно, на протяжении лет, а не мимолетно и случайно.



Наши трейдеры при торговле у Вас отмечают, что ночью спред (например, по кроссам канадца) расширяется в несколько этапов. А утром, когда в других ДЦ спред уже снизился, у «FIBO» он по-прежнему высокий. С чем это связано?

Как компания маркет-мейкер, мы несем рыночные риски. В нашей компании спред фиксированный, хотя в реальности на рынке спред плавающий, и его величина зависит от множества факторов. Мы же не изменяем его постоянно, в зависимости от рыночных условий, но в периоды экстремально высокой волатильности или низкой ликвидности иногда по некоторым инструментам мы вынуждены расширять спред. Хотелось бы отметить, что, как правило, величина расширения незначительна, и, как только позволяют рыночные условия, спреды возвращаются к своему фиксированному значению.



Рекламные кампании «FIBO Group» менее агрессивны, чем проводимые многими ДЦ. В связи с чем возникает вопрос - как Вы привлекаете новых клиентов?

Мы стараемся не быть навязчивыми. Наша модель построена на том, что клиенты находят нас сами, и нам это удается. Кроме того, хотелось бы отметить, что значительный процент клиентов выбирает FIBO по рекомендациям трейдеров, торгующих у нас. И это для нас - лучшая реклама.



Какие перспективы в ближайшем будущем ждут Ваших клиентов? В чем заключается стратегия развития компании?

Повышение открытости, стабильности, ввод новых продуктов и услуг - это основные задачи на будущее. В этом году мы стали участниками торговой сети Integral, что позволит нашим клиентам торговать с ведущими финансовыми институтами. В планах - расширение числа контрагентов и улучшение условий. Запущены процессы получения лицензий в различных странах, подробности будут по факту их получения, раньше говорить не хотелось бы, чтобы не быть голословным. В любом случае, мы не собираемся стоять на месте и будем прикладывать максимальные усилия для того, чтобы предложить клиентам лучшее. А что касается стратегии, то она проста: предлагать трейдерам лучшее из того, что есть на рынке, сохраняя свою репутацию надежного партнера.



Как Вы относитесь к мнению, что на рынке продолжительное время с прибылью торгует только 5% трейдеров. Как обстоят дела у клиентов «FIBO Group» - каков процент прибыльных клиентов у Вас?

Мы не считаем такие показатели, но, в целом, это цифры, близкие к правде.



Существуют ли, по Вашим наблюдениям, у трейдеров какие-то типичные ошибки, заканчивающиеся, как правило, сливом депозита?

Есть, и их много. Помимо общеизвестных, таких как отсутствие контроля рисков (money management) и психология торговли, есть и еще множество:

- 1) Трейдер уделяет торговле недостаточно времени;
- 2) Сильно завышенные ожидания по доходности;
- 3) Вера в то, что «торговать на рынке просто»;
- 4) Низкая финансовая грамотность;
- 5) Вера в чудо-сигналы, эксперты и т.п.;
- 6) Нахождение в позиции до тех пор, пока не закончатся деньги. Человеку психологически тяжело закрыть убыточную сделку, и, пока она не закрыта, он не воспринимает отрицательный результат как убыток. В результате, одна такая сделка перекрывает десятки положительных.



Существует мнение, что многие компании начинают «вставлять палки в колеса» тем трейдерам, которые начинают показывать стабильно большую прибыль. Это может объясняться тем, что данные компании относятся к разряду так называемых «кухонь», и слив трейдера для них выгоден. Как обстоят с этим дела у компании «FIBO Group»? Может ли трейдер, работая с Вами, быть уверенным в том, что он получит заработанное?

Да, наши клиенты могут быть уверены в получении выигрыша и неизменности наших торговых правил. Мы заботимся о своей репутации.



Максим Николаевич, позвольте теперь задать Вам несколько личных вопросов. Что для Вас успех, и какими атрибутами, по Вашему мнению, должен обладать успешный человек? Считаете ли Вы себя успешным?

В моем понимании, успех - это добиться желаемого и, при этом, сохранить умение радоваться простым вещам.



Скажите, являетесь ли Вы активным трейдером? И если да, то какие стратегии предпочитаете использовать в торговле?

Нет, время, к сожалению, не позволяет мне торговать активно. Я торгую время от времени, это мое хобби, хотя я нарушаю правило «нет времени на торговлю - лучше не торговать». Торговля требует времени!

Максим Николаевич, спасибо за интервью. Желаем Вам и Вашей компании дальнейшего процветания! ■



Ольга Хазиева

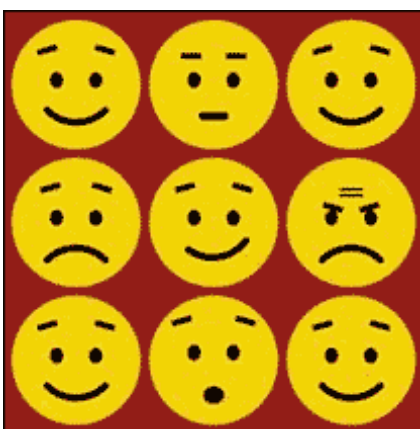
Преподаватель авторских учебных курсов по социологии, социальной психологии, основам менеджмента и маркетинга. Окончила аспирантуру по социологии. Автор ряда статей по социологии и социальной психологии. Опыт преподавания более 5 лет.

ВЛАСТЕЛИН ЭМОЦИЙ, ИЛИ КАК НАУЧИТЬСЯ ДЕРЖАТЬ СВОИ ЭМОЦИИ «В УЗДЕ»

«Много людей знают, что делать, и все же очень немногие способны сделать то, что они знают».

Дж.Харрисон

Как известно, для того чтобы поддерживать торговую дисциплину, чрезвычайно важно быть спокойным и уметь управлять своими эмоциями. Однако лишь немногие трейдеры могут похвастать тем, что легко достигают состояния внутреннего равновесия либо обладают этой способностью от природы. Для большинства все же характерна эмоциональная реакция на события, связанные со стрессовыми факторами. Вероятно, каждый трейдер хотя бы раз замечал в своей работе, что ему трудно справиться с натиском эмоций, а это, как правило, негативно влияет на результаты торговли. Не удивительно, ведь трейдинг относится к числу профессий, сопряженных с высоким уровнем стресса, поскольку присутствует постоянный риск в один момент потерять вложенные средства. Со временем большинству удается более или менее совладать с собой, поставив эмоции под контроль, но у некоторых так и не получается научиться контролировать себя.



Основные **эмоциональные реакции**, связанные с результатами торговли – это чувство радости (счастье, вдохновение, эйфория, прилив сил, надежда), когда есть прибыль и чувство боли (расстройство, гнев, упадок сил, тоска, разочарование, отчаяние, беспомощность), когда появляется убыток. Трейдинг представляет собой лавирование между этими эмоциями. Зачастую перепад эмоций бывает настолько экстремальным, что для человека с неустойчивой психикой может оказаться серьезным испытанием, грозящим **истощением нервной системы**. Поэтому, чем больше внимания вы уделите проблеме контроля эмоций, тем больше у вас шансов смягчить их влияние и достичь состояния эмоционального равновесия.

Один из успешных трейдеров говорил, что, в идеале, эмоциональное состояние трейдера во время торговли должно оставаться настолько ровным, что другие люди по выражению его лица судить о результатах его торговли. Это возможно в том случае, когда трейдер спокойно **без лишних эмоций** относится к результатам своих сделок – как

положительных, так и отрицательных. Убыток для него – это неотъемлемая часть работы, предусмотренная им в финансовом плане торговли, а прибыль – своего рода закономерное следствие дисциплинированной торговли и верно выстроенной торговой системы, не вызывающее особой эйфории. Его цель – спокойно работать, следуя плану, он сосредоточен не столько на получении прибыли, сколько на процессе торговли.

Отсутствие четкого плана чревато усилением эмоционального напряжения, поскольку, если вы не ориентируетесь на правила торговой стратегии, то, стало быть, вы опираетесь в торговле на собственные инстинкты и интуицию. При этом ваша торговля становится слишком **эмоционально уязвимой**, ибо, совершая ошибку, вы подвергаете риску чувство собственного достоинства («Я не смог принять верное решение, увидеть тенденцию...», «Я не достаточно умен/опытен/хорош...» и т.д.) В результате страдает ваше эго, что у любого человека всегда вызывает особенно сильные эмоции. Кто-то начинает винить и высмеивать себя, кто-то впадает в тоску или панику, а кто-то становится агрессивным и злится на весь мир... Руководствуясь же в работе планом торговли, вы опираетесь на логику и объективные данные (например, на показания технического индикатора). При этом вы понимаете, что любой, даже самый хороший индикатор, в определенных случаях может не сработать, и если сделка идет против вас, то, как только достигнута цена стопа, вам остается просто механически закрыть ее. В итоге, при отрицательном результате ваше самоуважение не пострадает в такой степени, что уберезет вас от бури совершенно ненужных эмоций и поможет остаться в комфортном эмоциональном состоянии. Таким образом, с помощью четкого планирования вы можете держать свои эмоции в узде.



Итак, план у нас есть, однако иногда нам не хватает дисциплины, чтобы соблюдать его. Что же в этом случае нам мешает?

Психологи рассматривают проблему влияния эмоций, препятствующих соблюдению торговой дисциплины, как проблему **импульсивности**. От природы импульсивный человек не может отложить вознаграждение. Например, в ходе исследования людям предлагали выбрать между немедленным получением маленькой суммы денег (50\$) и гарантированным получением крупной суммы (1000\$) через несколько месяцев. К удивлению ученых, далеко не все из экспериментируемых согласились ждать, многие предпочли получить скромное вознаграждение, но уже сегодня.

В другом исследовании психологи решили изучить, как можно **управлять своими эмоциональными импульсами**, и, поскольку в роли испытуемых были дети, в качестве вознаграждения вместо денег им предлагались бублики. Дети были немного голодны и, нажав кнопку звонка, могли моментально получить бублик, но если бы они подождали немного, отложив вознаграждение, то получили бы большее вознаграждение – целую связку бубликов. Как выяснилось, на способность отложить вознаграждение в первую очередь влияла **видимость вознаграждения**: если бублик лежал прямо перед детьми, то они в подавляющем большинстве не могли откладывать вознаграждение и предпочитали съесть один бублик сейчас, нежели ждать связку потом. Те дети, которые смогли отложить вознаграждение, оказывается, просто **меняли точку зрения** на него – например, представляли бублики не как еду, а как пластмассовые игрушки, либо представляли, что бублик не настоящий, а нарисованный – тогда им было существенно легче откладывать вознаграждение.

«Какое же отношение имеют бублики к трейдингу?» – спросите вы. Давайте посмотрим, как интуитивную находку детской психики можно использовать в торговле. Во-первых, **видимость награды**. Если вы все время сидите у монитора и контролируете ход сделки на экране, то вы постоянно испытываете соблазн «поиграть», вместо того, чтобы терпеливо ждать сигнала

на выход из сделки. Чтобы не поддаваться искушению и избежать необдуманных решений, перестаньте гипнотизировать экран, лучше используйте фиксированные уровни стопа и профита. Это поможет вам не нарушать ваш план торговли и противостоять естественному, в сущности, желанию закрыть прибыльную сделку немедленно, не ожидая сигнала на выход. Во-вторых, **смена точки зрения**. Дело в том, что если трейдер рассматривает капитал, вложенный в сделку, как реальные деньги, которые можно потратить, и представляет за ними реальные блага, то ему будет гораздо труднее сохранять объективность в ходе торговли и противостоять сильнейшим человеческим эмоциям - страху и жадности. Намного полезнее поменять точку зрения и видеть за вложенной суммой не определенное количество «домов и парашютов», а просто абстрактные цифры, не касающиеся материальных вещей. Это поможет сохранять бесстрастность и логичность в ходе сделки, и вы сможете торговать более дисциплинированно и последовательно.

Еще в одном психологическом исследовании было выявлено, что на нашу способность к самоконтролю влияет также **размер вознаграждения**, которое получит человек, выполнив определенную задачу. Например, когда в ходе эксперимента людям предлагали небольшое вознаграждения за решение различных задач, требующих сосредоточенности, то они быстро утомлялись и не могли сосредоточиться. Если же размер обещанного вознаграждения увеличивали, то люди гораздо дольше сохраняли внимание и самоконтроль. В сущности, это естественное для человека поведение – если ставки высоки, награда значима и желательна, то воля «собирается в кулак» и открывается «второе дыхание».

Что касается трейдинга, то размер потенциальной прибыли, естественно, оказывает огромное влияние на самоконтроль. Если трейдер не получает достаточной прибыли, то ему сложно поддерживать дисциплину – в такие моменты люди часто отодвигают планы торговли в сторону.

Психологи доказали, что способность управлять своими эмоциями зависит также от **суммы психологических ресурсов**, которыми располагает человек. Как известно, для того чтобы сохранять самоконтроль, требуется **физическая и психическая энергия**, причем, чем более дисциплинированным вы должны быть, тем больше энергии требуется для продолжения работы. В ходе эксперимента, если человек одновременно должен был выполнять несколько сложных задач (например, держать в памяти список из нескольких слов и решать интеллектуальные задания), то его умственные ресурсы напрягались до предела, он уставал и терял самообладание. Другими словами, у него не оставалось психологических ресурсов для того, чтобы сосредоточиться поддерживать дисциплину.



В ситуации, когда у человека не хватает психологической энергии, даже изначально дисциплинированные люди не могут в значительной степени контролировать свои эмоции. Существует некий **порог усталости**, перейдя который, человек не может больше сохранять внимание, даже несмотря на размер обещанного вознаграждения. Дело в том, что уставший человек перестает адекватно оценивать потенциальную награду, ее значение для него снижается, и она больше не является для него значимым стимулом. У

каждого человека этот порог разный – он называется **стрессоустойчивостью**. Как при любой напряженной деятельности, в ходе торговли запасы энергии постепенно уменьшаются. В первую очередь это заметно у трейдеров, которые используют скальпинговые стратегии и за день многократно входят и выходят из рынка. Постепенно они ощущают усталость и замечают, что совершать сделку за сделкой становится все сложнее. Но поскольку для эффективной торговли и поддержания торговой дисциплины крайне важно **поддерживать психическую энергию на должном уровне**, то возникает закономерный вопрос - как же ее сэкономить? Наиболее очевидный путь – это ограничить число сделок, совершаемых за день. Однако есть и другие способы, о которых мы поговорим подробно в следующем выпуске нашего журнала. ■



Ренат Садриев (PeHaT)

Стаж работы на рынке Forex более 2 лет. В сферу интересов также входят фьючерсные инструменты товарных и фондовых рынков. Активный член сообщества трейдеров компании «LepreconTrading». Занимается разработкой нестандартных торговых систем.

ТОРГОВАЯ СИСТЕМА НА ОСНОВЕ ЦЕНОВЫХ КАНАЛОВ «TFL»

Приветствую дорогих читателей! Сегодня я хочу предложить вашему вниманию торговую систему собственной разработки на основе ценовых каналов (диапазонов).

Торговые системы, использующие ценовые каналы, широко применяются трейдерами благодаря тому, что они являются простыми, наглядными и психологически естественными, а статистика подтверждает их высокую эффективность на многих рынках. В литературных источниках можно найти много подходов, основанных на различных конструкциях ценовых диапазонов.

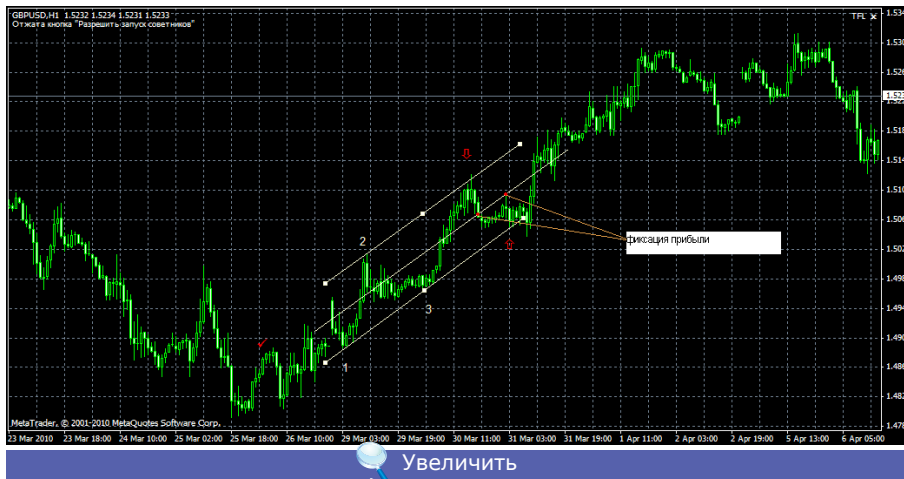
Идея всех этих подходов состоит в непосредственном использовании свойств канальных линий на рыночных графиках. Как известно, если цена встретила линию канала, то возможны два сценария:

- 1) Эта линия будет пробита, после чего продолжится ход в направлении прорыва;
- 2) Цена не сможет пробить линию, произойдет разворот и будет ход в обратном направлении.

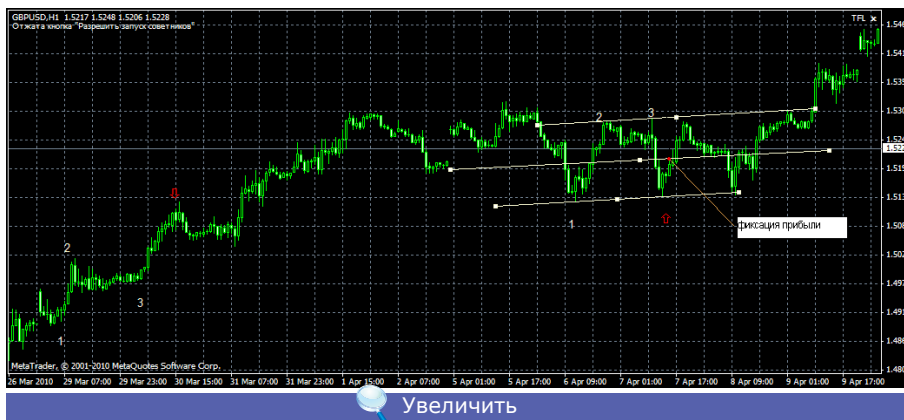
ПОСТРОЕНИЕ ЦЕНОВЫХ КАНАЛОВ В ТОРГОВОЙ СИСТЕМЕ «TFL»

Для построения используются тайм-фреймы M15 и H1. Для того чтобы открыть позицию, достаточно трех точек-экстремумов, с четвертой точки надо открываться. Суть построения такова, что после того, как сформировалась третья точка, надо соединить линией два нижних или верхних экстремума и провести строго параллельную ей линию с экстремума на противоположной стороне. Наглядно на графике это выглядит так:





ТОЧКА ЗРЕНИЯ



ТОЧКА ЗРЕНИЯ

Это случайно взятый мной период с 26.03.2010 по 12.04.2010. Фиксация прибыли производится на 50% от рэнджа (ширины канала). Таким образом, в процессе торговли все удачные входы дали в совокупности прибыль в размере 560 пунктов. Однако не стоит слишком радоваться, потому что ложных входов получается достаточно много, в количественном соотношении иногда даже больше, чем прибыльных. Ниже привожу рисунки с ложными входами.





ТОЧКА ЗРЕНИЯ



ТОЧКА ЗРЕНИЯ

Размер стопа в 10 пунктов для данной стратегии я считаю оптимальным, т.к. при пробитии ценового канала на 10 пунктов линии перестают быть параллельными. Эта торговая стратегия имеет хорошее соотношение размера средней прибыльной сделки к средней убыточной (от 3:1 до 15:1). Размер прибыльной сделки зависит от ширины торгового диапазона - чем шире канал, тем больше прибыль, то есть, несмотря на возможность большого количества ложных входов, размер прибыльной сделки позволяет в итоге остаться в профите. Если рассматривать младшие тайм-фреймы, например M15, то картина не сильно отличается, потому что те же каналы, которые мы видим на H1, хорошо проглядываются и на M15.

При торговле по этой стратегии необходимо иметь ввиду некоторые моменты.

Признаки пробития канала:

1. На графике вблизи точки, от которой планируется открытие позиции, вырисовывается фигура продолжения тренда.
2. За короткий промежуток времени цена более одного раза касается одной из сторон ценового диапазона, ни разу не коснувшись другой.
3. На большем тайм-фрейме ценовой канал противоречит ценовому каналу текущего тайм-фрейма.

Признаки разворота от линии канала:

1. Цена моментально отскакивает от линии канала, являющейся поддержкой или сопротивлением.
2. Совпадение с ценовым каналом на большем тайм-фрейме.

Чтобы обезопасить торговлю, после открытия и хода цены в нужном направлении надо ставить стоп в "безубыток". В зависимости от общего тренда на старших тайм-фреймах, можно усредняться в случае пробития.

ПРАВИЛА ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ «TFL»

1. Линии должны быть строго параллельными;
2. Не входить, если экстремумы не ярко выражены;
3. После пробития ценовой канал полностью аннулируется;
4. Не использовать для построения канала большие, чем H1, тайм-фреймы, т.к. при этом возникает необходимость увеличить размер стопа. Например, чтобы на H4 определить, точно ли пробит ценовой канал, 10-ти пунктов будет недостаточно. На дневных и недельных графиках размер стопа будет уже чрезмерно большим для хорошего входа. А если рассчитать умеренный риск, как при торговле на H1, то в итоге прибыль на четырехчасовых, дневных и недельных графиках будет меньше из-за более редких входов.
5. Вход должен осуществляться четко при касании линии. Отклонение более чем на три пункта считаю неприемлемым.

Торговых стратегий на основе ценовых каналов много, но, в отличие от "TFL", они не отличаются подробным описанием - даются только общие условия и никаких правил построения ценовых каналов. В итоге, при торговле часто остаются сомнения, правильно ли найден ценовой канал.

ПРЕИМУЩЕСТВА ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ «TFL»:

1. Наглядность торговой системы;
2. Хороший ММ.

НЕДОСТАТКИ ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ «TFL»:

1. Зависимость от котировок. Котировки разных брокеров отличаются, и это может ввести в заблуждение при построении каналов.

2. Риск получения подряд большого количества ложных входов. У меня бывало максимум семь входов подряд с последующим пробитием, но такие случаи достаточно редки.

Удачи и профитов! ■

Если у Вас возникли вопросы по изложенному материалу, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Также хотим напомнить, что рубрика «Точка зрения» была создана специально для того, чтобы дать возможность всем желающим выступить от первого лица с какой-то интересующей его темой: описать свою торговую стратегию, рассказать о хитростях торговли или методиках, позволяющих сделать торговлю более прибыльной. Если Вы хотите стать одним из авторов этой рубрики, и Вам есть, что сказать, то пишите нам для согласования деталей публикации.

Написать письмо



РЕЙТИНГ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

В данном разделе нашей Лаборатории мы проводим мониторинг советников, торгующих только на реальных счетах. Вы можете оценить основные характеристики представленных советников и наблюдать за их работой: <http://ealab.ru/members.php>

Рейтинговая таблица лидеров на сегодняшний день выглядит так:

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста	Прибыль с бонусов Лепрекона
	MultiMartingail	9445	12,588.40	10,279.60	108 дней	1.51
	Primeval-EA	5070	10,653.10	14,815.30	53 дней	12.4
	GeLan Trawler 2.0	3997	10,838.80	15,740.00	94 дней	0.09
	Pips Miner EE	3003	17,780.60	22,259.20	99 дней	4.14
	Magic Forex Bot	895	11,344.50	16,448.50	24 дней	0.15
	SPIKE EA	662	15,905.10	15,881.10	101 дней	3.96
	EXDeLuxe	541	36,921.20	41,921.20	66 дней	30.39
	Euronis_v4	408	145.72	145.72	205 дней	402.33
	MegaDroid	379	144.37	144.37	231 дней	3.75
	Forex Shocker 2.0	297	135.64	135.64	108 дней	18.27

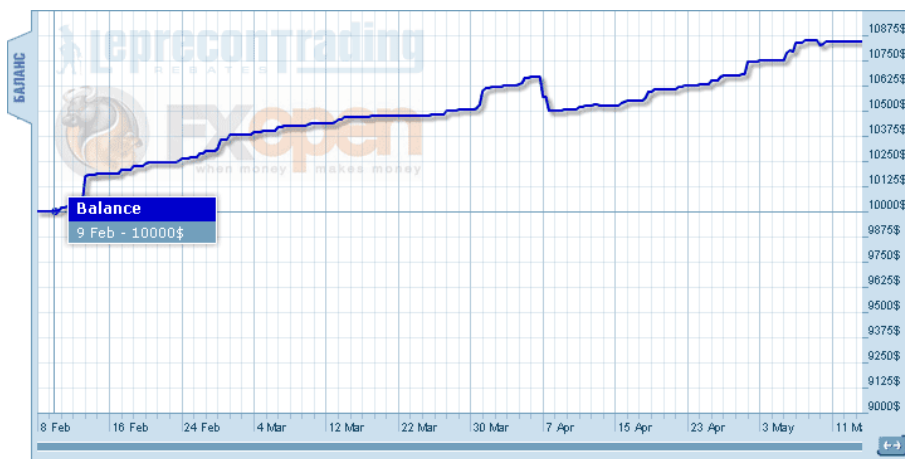
Рассмотрим более подробно первую пятерку:

Первое место по заработанным пипсам - за советником «MultiMartingail». В мониторинге советник находится 108 дней. По сравнению с предыдущим месяцем сумма баланса на депозите немного уменьшилась, но при этом немного уменьшилась и просадка по эквити. В настоящий момент она незначительно выше начального депозита.

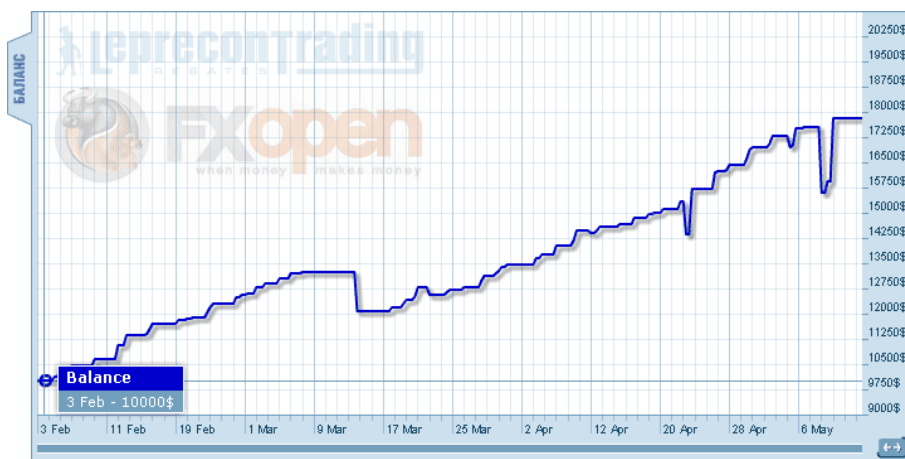


Откатился на **второе место** - «Primeval-EA». Его убыток за месяц составил 3607 пипсов.

На **третье место** поднялся советник «GeLan Trawler 2.0». 94 дня в мониторинге. Работает по двухстороннему методу Мартингейла. Торгует без стопов – ордера кроются по внутреннему алгоритму. За месяц показал хороший прирост по пипсам, но прирост депозита при этом произошел не столь существенный. Результат по пипсам +2066 и прибавка 2.6% к балансу прошлого месяца.



Четвертое место - «Pips Miner EE». В рейтинге 99 дней. Благодаря правильному ММ, советник быстро выбрался после убыточных сделок и показывает прирост в 19% к результату прошлого месяца.



На **пятом месте** - новичок рейтинга **«Magic Forex Bot»**. В рейтинге он 24 дня, при этом заработал 895 пипсов и увеличил начальный депозит на 12%. Максимальная просадка составляет 1.53%.

Подробный обзор данного советника Вы можете прочитать в этом номере журнала.



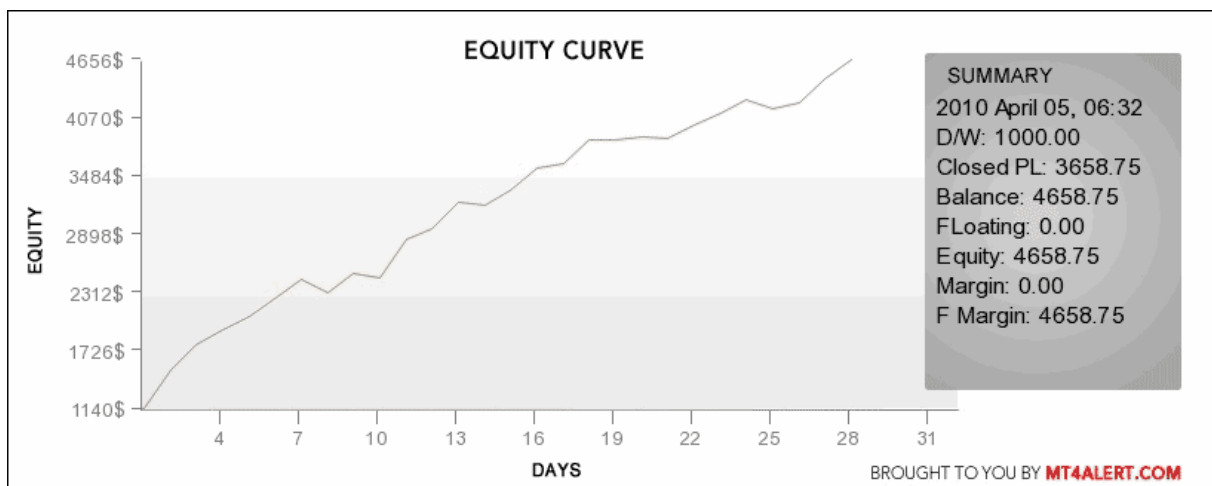
Вспоминая поговорку «Семь раз отмерь – один раз отрежь», мы призываем вас не рисковать своими деньгами и делать выводы о целесообразности покупки того или иного советника только после наблюдения за его работой на реальных счетах в нашей Лаборатории <http://ealab.ru/members.php>

НОВИЧКИ РЕЙТИНГА

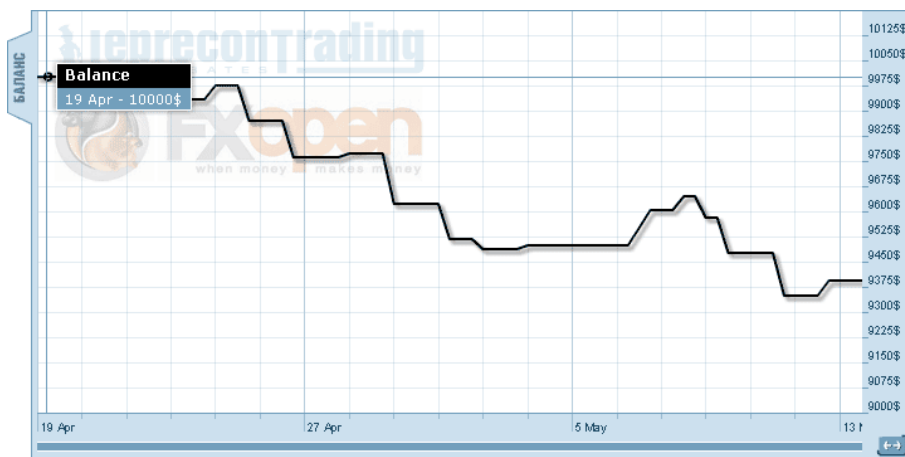
«CASH ROCKET» И «CASH ROCKET TURBO»

«Cash Rocket» торгует на парах USD/CHF и EUR/CHF. Период M15 и M30.


«Cash Rocket Turbo» торгует на паре EUR/GBP.



Результаты торговли советников пока сомнительные. За 24 дня мониторинга «Cash Rocket Turbo», несмотря на многообещающую приставку «turbo», сократил размер депозита на 251 пипс.



«Cash Rocket» заработал за это же время 234 пипса, но прирост к депозиту составил всего 0.5%

Статус	Название	Пипс	Баланс	Зивити	Общее время теста
	Cash Rocket Turbo	-251	9,393.13	14,393.10	24 дней
	Cash Rocket	234	10,046.30	15,046.30	24 дней

Посмотрим, что эти «ракеты» покажут нам дальше.

<http://ealab.ru/members.php> ■



РЕЙТИНГ СИГНАЛЬНЫХ СЕРВИСОВ


Данный раздел посвящен сервисам, предоставляющим торговые сигналы. Для того чтобы оценить множество таких сервисов в одном месте, не шаря по интернету в поисках информации, мы создали данный раздел. Мы предоставим Вам всю необходимую информацию, и Вы сами сможете решить, чьими сигналами хотели бы воспользоваться.

Добро пожаловать!

<http://ealab.ru/members.php?t=2>

За последний месяц рейтинг положительно торгующих сервисов менялся несколько раз. Появлялись новые участники, потом снова пропадали. В итоге, на данный момент в рейтинге по-прежнему находится только один сервис.

«RADOVSIGNALS»

Статус	Название	Тип	Баланс	Эквити	Общее время теста
	RadovSignals	3377	13,817.50	13,649.20	211 дней

Несмотря на то, что за последний месяц результат торговли был отрицательный и составил 832 пипса убытка, суммарный баланс сервиса остается положительным. 3377 пипсов прибыли за 211 дней мониторинга. 38% прироста к начальному депозиту. Максимальная просадка 1.31%.



Торгуемые пары: EUR/USD, GBP/USD и USD/CHF

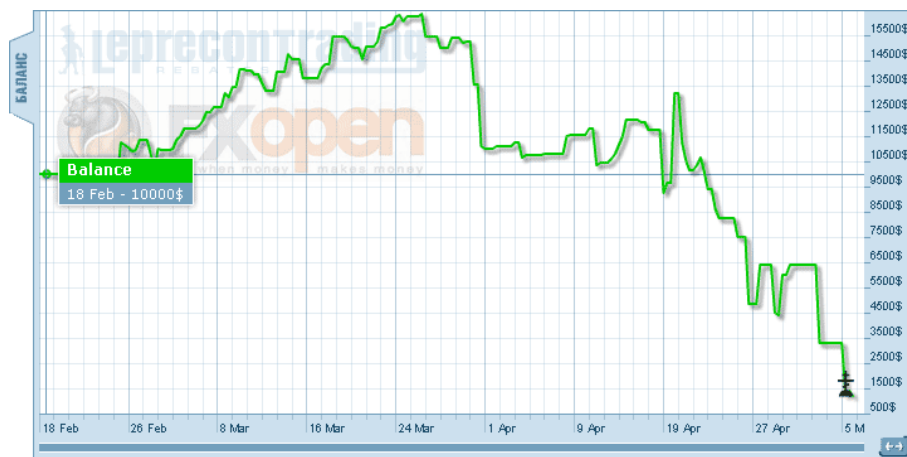
Время торговли: дневное время с 12:00 до 23:00 МСК

Основные правила работы: При регистрации Вы указываете один или два своих e-mail адреса - основной и резервный, номер мобильного телефона для получения SMS и номер ICQ (если он у Вас есть). После оплаты и присвоения Вам одного из тарифных планов и активации учетной записи Вы начинаете получать торговые сигналы на эти данные.

«PROFIT – INTRADAY SYSTEM»

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	Profit - IntraDay System	-6701	859.72	636.21	78 дней

Итогом работы «Profit – IntraDay System» после 78 дней мониторинга стал слив депозита. Увы, ребята так и не смогли выбраться из просадки после серии убыточных сделок:



«SIGNALSFSS»

Не лучшим образом обстоят дела и у сервиса «SignalsFSS» из раздела «Второй шанс». Приходится констатировать, что вторым шансом сервису воспользоваться не удалось, и после 34 дней мониторинга произошел слив начального депозита по эквити:

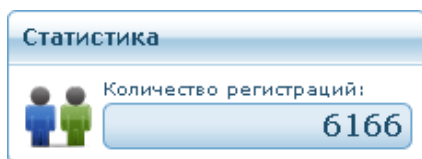
Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	SignalsFSS	540	155.18	5.69	34 дней



Понаблюдаем, как дальше пойдут дела у наших сигнальчиков. Следите за новостями!

<http://ealab.ru/members.php?t=2> ■

ЮБИЛЕЙНЫЙ КЛИЕНТ КОМПАНИИ «LEPRECON TRADING»



Количество клиентов компании «Leprecon Trading» превысило уже 6100! Как мы и обещали в последних выпусках нашей рассылки для клиентов компании «Вестник Лепрекона», 6000-го клиента ждет приятный сюрприз.

Настало время познакомить Вас с юбиляром. Им оказался Андрей Соколовский. Андрей получает от компании «Leprecon Trading» денежный бонус в размере 50\$.



Андрей, расскажите немного о себе и о том, как произошло Ваше знакомство с трейдингом?

Я живу в городе-герое Минске, хотя последние три года прожил в Штатах, где и познакомился с трейдингом. Сейчас это моя основная работа.

Как давно Вы занимаетесь торговлей, и на каком рынке предпочитаете торговать (Forex, фьючерсы, акции)?

Торгую, в основном, валюты, иногда балуюсь фьючерсами. На рынке три года.

Как Вы узнали о компании «Leprecon Trading»?

О компании узнал по ссылке на одном из сайтов, посвященных торговле на рынке Forex, где я обучался около 2-х лет. Однако торгую, в итоге, совсем по другой системе :) Очень рад, что на постсоветском пространстве появился такой замечательный сервис по возврату части спреда. В Штатах такого не встречал.

Спасибо за теплые слова! Мы, в свою очередь, желаем Вам удачи в торговле и процветания вместе с компанией «Leprecon Trading»!



КТО ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?

Сначала позволим себе сказать пару слов о том, для чего создавалась данная статья. Дело в том, что, когда мы начали делать наш журнал «Leprecon Review», он планировался больше для клиентов компании. Но потом мы увидели интерес к нашему изданию также со стороны тех, кто пока еще не примкнул к дружным рядам наших клиентов, но интересуется вопросами биржевой торговли, ее автоматизации, поиска различных методов и стратегий для успешной работы на рынке. Количество наших читателей растет с каждым днем, на наш электронный адрес постоянно поступают письма с просьбами, пожеланиями и предложениями, среди которых достаточно часто можно увидеть похожие вопросы:

- А кто такой Лепрекон?
- Почему именно Лепрекон?
- Чем занимается компания «Leprecon Trading»?

Поэтому мы решили, что эта статья поможет каждому новому клиенту компании «Leprecon Trading» узнать больше о нас и о том, что Лепрекон - это не просто название, а символ будущего успеха!

ИТАК, КТО ЖЕ ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?



Лепрекон – это маленький сказочный человечек в шляпе и зеленом костюме, владеющий спрятанным горшком золота. Если удачливому искателю сокровищ удастся поймать Лепрекона, то это существо должно рассказать человеку о том, где спрятаны его сокровища.



Лепрекон считается символом Дня Святого Патрика, который празднуется 17 марта во многих странах мира. Родиной этого праздника является Ирландия. Изображение Лепрекона можно встретить в этот день где угодно: на майках, плакатах, значках и т.д. Этот праздник принято встречать в зеленой одежде (зеленый - цвет весны, Ирландии и трилистника). Желательно также декорировать свой костюм стилизованным трилистником и ирландским флагом. Особым шиком считается приколотый к лацкану пучок живого трилистника, который ирландцы перед Днем Святого Патрика развозят по всему миру для продажи.

На вопрос о том, почему же компания «Leprecon Trading» стала называться в честь Лепрекона, во втором номере нашего журнала ответил основатель, руководитель и идейный вдохновитель компании Игорь Дягилев, известный в сети под ником Ree:

«Я долгое время жил и работал в Ирландии. Символика зелёного листка и самого Лепрекона используется ирландцами везде, где только можно. Считается, что это

приносит удачу не только в бизнесе, но и в личной жизни. Назвав так компанию, мы хотим принести удачу всем нашим клиентам. Скажу по секрету, у меня тоже есть статуэтка Лепрекона, купленная в одной из небольших деревушек северного Корка в Ирландии. Она всегда со мной, когда я работаю и отдыхаю».

ЧЕМ ЗАНИМАЕТСЯ КОМПАНИЯ «LEPRECON TRADING»?

«LepreconTrading» - крупнейший в рунете сервис по компенсации затрат на спред в большинстве известных ДЦ и Брокерских компаний. Торгуя через «LepreconTrading», Вы сможете получать часть спреда на свой счет по каждой закрытой Вами сделке, независимо от ее результата.

Чтобы разобраться в нюансах, рассмотрим, что же вообще такое спред.

В терминале MetaTrader Вы можете увидеть такую картинку.

Символ	Бид	Аск
EURUSD	1.4397	1.4399
GBPUSD	1.6411	1.6414
USDCHF	1.0250	1.0253
EURCAD	1.4768	1.4777
AUDNZD	1.2509	1.2521
EURJPY	130.34	130.37
USDJPY	90.52	90.55

Справа от каждой валютной пары находятся две цены: Бид и Аск – цены спроса и предложения. Разница между ними - и есть тот самый спред, который, при открытии сделки, трейдер уже «заплатил» брокеру.

Для примера, на приведенном скрине спред по EUR/USD равен 2 пипса, по GBP/USD 3 пипса, по USD/CHF 3 пипса, по EUR/CAD 9 пипсов. Таким образом, торгуя через брокера напрямую, Вы теряете с каждой сделки сумму, эквивалентную величине спреда.



А при торговле через компанию «LepreconTrading» часть этого спреда возвращается компании, которая, в свою очередь, выплачивает 70% от данной суммы клиенту.

У тех брокеров, у которых вместо спредов с каждой сделки удерживается комиссия, расчет ведется аналогично, но производится не со спреда, а с комиссии.

При всем при этом подключение к сервису совершенно бесплатное и нет никаких скрытых платежей.

В настоящее время для подключения доступны 43 (!!!) компании, и этот список не окончательный – если Вы торгуете в компании, которой пока нет в списке, то пишите нам – мы постараемся, чтобы интересующая Вас компания была в нашем списке:

Брокеры

Если Вы торгуете в компании, которой нет в нашем списке, то свяжитесь с нами и мы постараемся добавить такую компанию в самые короткие сроки.

ТАКЖЕ «LEPRECON TRADING» ЭТО:

ЛАБОРАТОРИЯ



<http://ealab.ru>

Лаборатория, посвященная тестированию торговых систем, сигналов, включая АТС и МТС. Как известно, в последние несколько лет в Интернете активизировались продажи торговых систем, которые, при более близком рассмотрении, зачастую оказываются обманом. Так как мы сами являемся трейдерами и знаем, насколько важна в наши дни правильная информация, мы решили создать этот раздел для помощи трейдерам.

АТС			МТС			Сигналы			Второй шанс																	
#	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S	T	U	V	W	X	Y	Z
Статус	Название					Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста	Прибыль с бонусов Лепрекона	Ссылки															
	MultiMartingail					9345	12,578.80	10,198.20	107 дней	1.51	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Primeval-EA					5005	10,519.60	14,626.40	52 дней	12.07	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	GeLan Trawler 2.0					3994	10,838.40	15,740.10	93 дней	0.09	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Pips Miner EE					3003	17,780.60	21,742.50	98 дней	4.14	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Aladdin 2 FX					2280	73.01	5,073.02	34 дней	7.45	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Forex No Loss Robot					1503	11,364.60	7,154.29	120 дней	1.26	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Magic Forex Bot					895	11,344.50	16,322.20	23 дней	0.15	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	SPIKE EA					652	15,775.10	15,775.10	100 дней	3.83	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	EXDeLuxe					509	36,441.20	41,441.20	65 дней	29.43	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	MegaDroid					379	144.37	144.37	230 дней	3.75	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Euronis_v4					378	138.10	138.10	204 дней	398.72	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															
	Forex Shocker 2.0					288	133.84	133.84	107 дней	17.67	<ul style="list-style-type: none"> ↳ Просмотреть statement ↳ Обсудить на форуме ↳ Оставить комментарий 															

ФОРУМ

<http://forum.leprecontrading.com>

Форум создан для общения и обмена опытом между трейдерами. На форуме обсуждается множество важных вопросов: торговые стратегии - их оптимизация и практическое использование, механические торговые системы, выбор брокера, рассматриваются сопутствующие трейдингу темы - банки, платежные системы, инвестиции, ПАММ-счета и многое другое.

FREELANCE РАБОТА И ПРЕДЛОЖЕНИЯ		ТЕМЫ	СООБЩЕНИЯ	ПОСЛЕДНЕЕ СООБЩЕНИЕ
	Правила и условия обсуждения 0.04 Правила подачи заявки	2	2	rigal 31 авг 2009, 14:52
	Заявки 0.04 Здесь оставляем свои заявки и общаемся с кодерами	2	11	Papirus 16 янв 2010, 14:59
ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК FOREX		ТЕМЫ	СООБЩЕНИЯ	ПОСЛЕДНЕЕ СООБЩЕНИЕ
	Торговые стратегии и сигналы 0.04 Обсуждаем торговлю и сигналы. Делимся секретами, высказываем идеи. Модератор: Ree	16	231	fxprofit 31 мар 2010, 10:42
	Прогнозы, аналитика, мнения 0.02 Технический и фундаментальный анализ ситуации на рынке. Модераторы: Ree , Андрей, Ленточка	8	458	dmitrievsky Сегодня, 12:55
	Механические торговые системы 0.06 Обсуждение МТС Модератор: Ree	5	49	Ajuy 30 апр 2010, 13:22
	Торговая комната 0.02 Торгуем и обсуждаем в реальном времени. Модератор: Ree	3	88	Nikospart 06 май 2010, 13:44

Re: Моя стратегия лучше вашей! :) “ЦИТАТА”

begemor » 20 фев 2010, 03:51

II_AlexUnder_II а как по твоему лучше применять манименджмент к ТНУ? Лично я не приветствую короткие таймфреймы потому как сливаю на них. Нашел для себя среднесрочную стратегию Kijun-Sen Bandit. Основана на 6ти индикаторах. В среднем дает 2-3 сильних сигнала в неделю по основным парам. Сделки держу от нескольких часов до нескольких суток. Таймфрейм H1 реже H4. Прибыль в среднем от 50ти до 200 пунктов от сделки. На кросах лучше не использовать так как часто дает ложные сигналы.

begemor

Сообщения: 2
Зарегистрирован: 13 фев 2010, 21:41
Благодарил (а): 1 раз.
Поблагодарили: 1 раз.
Сказали "Фу": 0 раз.
Банк: 0.04




ВЛОЖЕНИЯ

СПАСИБО


АРХИВ КОТИРОВОК


<http://leprequotes.com>


Новый сайт представляет собой онлайн библиотеку рыночных котировок. Так как история котировок очень важна и, самое главное, серьезно востребована среди пользователей автоматических торговых систем, нами была создана база данных котировок, запись в которую происходит круглосуточно и в реальном времени.


 Бесплатно скачать историю рыночных котировок  

[Главная](#) | [О нас](#) | [Новости](#) | [FAQ](#) | [Форум](#) | [Контакты](#)

 **мы просто платим!**

Шаг 1  **Никакой регистрации!**

Шаг 2  **Выбери брокера, символ и дату**

Шаг 3  **Скачивай бесплатно!**

Статистика:
Компаний: 7
Типов счетов: 20
Символов: 961
Скачано раз: 100
Котировок: 21223268

Компания:

Тип счета:

Символ:

Дата до

СКАЧАТЬ

На данный момент по всем компаниям доступна только история котировок с 01 Апреля 2010 года.

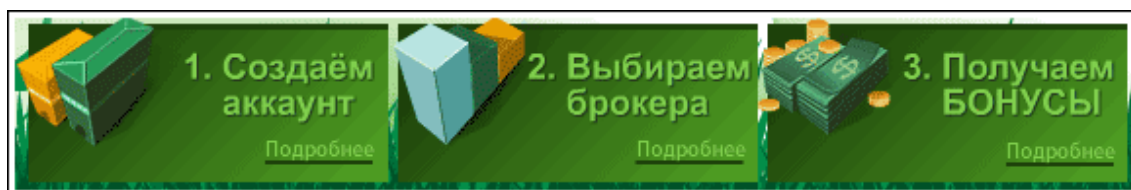
А ТАКЖЕ «LEPRECON TRADING» ЭТО:

- Более 6000 клиентов!
- Ежемесячный электронный журнал «Leprecon Review»;
- Еженедельная рассылка для клиентов компании с последними новостями, рейтингом торговых систем и анонсами «Вестник Лепрекона»;
- Бесплатный чат в Skype, где Вы можете задать интересующие Вас вопросы по торговле и получить на них ответы опытных трейдеров;
- Наша группа «**ВКонтакте**»;
- Дополнительные бонусы;
- Отсутствие комиссий и минимума на вывод;
- Различные акции и конкурсы для клиентов;
- Бесплатные вебинары по биржевой торговле, организованные совместно с нашими партнерами.

<http://leprecontrading.com>

КАК ЖЕ СТАТЬ КЛИЕНТОМ КОМПАНИИ «LEPRECON TRADING»?

Достаточно перейти по ссылке <http://leprecontrading.com> и следовать пошаговой инструкции:



Более подробное описание всегда можно найти в разделе FAQ на сайте:
<http://leprecontrading.com/faq.php>

КОНТАКТЫ

Редакция журнала:
review@leprecontrading.com

Главный редактор:
editor@leprecontrading.com

Для рекламодателей:
advertising@leprecontrading.com

По всем вопросам, связанным с содержанием материалов журнала, а также с замечаниями и предложениями обращаться на электронный адрес редакции журнала.



